

# 期货公司交易结算系统压力测试管理细则

## （试行）（征求意见稿）

**第一条【目的依据】**为规范期货公司交易结算系统压力测试工作，提升系统性能容量管理水平，防范因性能不足引发的业务连续性风险，保障期货市场安全稳定运行，依据《期货公司监督管理办法》《证券期货业网络和信息安全管理暂行办法》等规定，制定本细则。

**第二条【适用范围】**本细则适用于期货公司交易系统和结算系统的压力测试工作。

交易系统是指期货公司主席位交易系统（含 APP 交易系统），包括采用双活或者多活架构部署的系统。结算系统是指负责处理全部客户交易后的资金清算、交收、数据对账等流程的系统。

**第三条【制度机制】**期货公司应当建立压力测试管理制度，明确职责分工、工作流程，分配必要的专项资源，确保测试工具、数据及人力配置满足常态化开展压力测试的需要。

**第四条【测试周期】**期货公司应当至少每年开展一次交易结算系统压力测试，制定测试工作方案，明确测试目标、测试数据、测试环境、参与人员、测试步骤等。出现下列情形之一，可能影响系统安全稳定运行的，应当及时组织开展压力测试。

（一）相关系统或者网络设施新建上线、变更或者下线移除，对系统性能容量造成影响；

（二）市场行情大幅波动，委托、成交等大幅增加导致系统性能容量不足；

（三）中国证监会或中国期货业协会（以下简称“协会”）认定的其他需要进行压力测试的情况。

**第五条【测试环境】**期货公司应当使用生产环境或者与生产环境配置相当的测试环境及其他环境开展压力测试。使用生产环境开展压力测试的，应当充分进行测试风险评估，做好测试通知、生产环境数据备份、数据隔离、系统恢复及验证工作，避免影响系统正常运行。

**第六条【场景数据】**期货公司应当合理构造压力测试数据，将瞬时压力数据报入和持续压力数据报入纳入测试场景，并覆盖交易结算系统各业务环节和关联技术模块。

（一）交易系统压力测试数据至少包括订单委托、业务查询、客户登录等数据，相关数据构造应当充分结合交易系统不同时段的业务处理特点和业务压力情况；

（二）结算系统压力测试数据至少包括成交笔数、持仓量、账户数据等。

使用生产数据进行测试的，应当进行脱敏处理。无法脱敏的，应当采取与生产环境同等的数据安全保护措施。

**第七条【测试指标】**期货公司应当科学设定压力测试指标，测试交易结算系统的订单接收有效率、订单处理正确率、客户登录成功率、业务查询成功率及结算耗时等。

期货公司应当全面评估测试场景、数据、指标和结果的科学性，确保交易结算系统的性能容量不低于历史峰值的两倍。

**第八条【测试报告】**期货公司开展压力测试应当形成测试报告，提请公司总经理办公会审议，并至少保存五年。测试报告至少包括以下内容。

（一）基本信息：测试时间、测试环境、测试数据说明、测试场景说明等；

（二）系统信息：系统名称、系统类型、系统架构及部署情况、软硬件信息、测试工具等；

（三）测试结果：测试指标达成情况、未达标项的风险分析及改进计划、测试总体结论等。

**第九条【测试评估】**期货公司应当于每年 12 月底前，向协会和属地证监局报送本年度交易结算系统压力测试报告及相关测试方案。协会对行业压力测试开展情况和测试结果进行分析评估，并就有关情况报告中国证监会。

**第十条【场景要求】**期货公司按照本细则第五条、第六条、第七条准备测试环境、构造场景数据、明确测试指标，应当参照《证券期货业交易结算系统压力测试指南》基础合规场景有关内容，确保相关指标符合通过标准。

鼓励期货公司结合自身业务实际和交易结算系统情况，参考《证券期货业交易结算系统压力测试指南》，开展扩展增强场景和推荐补充场景的测试，多维度评估交易结算系统可用性和可靠性。

**第十一条【自律措施】**协会可以按照本细则对未按要求开展压力测试，或者测试结果不符合通过标准的期货公司发送整改通知，期货公司应当于收到整改通知后三个月内完成整改。

未按期完成整改的，或期货公司及其工作人员违反本细则规定的，协会可以视情节轻重对其给予纪律处分或者实施自律管理措施。

**第十二条【实施安排】**本细则由协会理事会审议通过，自发布之日起施行。