

《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）》起草说明

为进一步提升期货公司交易结算系统压力测试工作的有效性，保障系统安全平稳运行，在中国证监会指导下，中国期货业协会（以下简称协会）起草了《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）》（以下简称《管理细则》）。现就有关情况说明如下：

一、起草背景

近年来，我国期货市场规模持续扩大，品种体系日趋完善，机构参与度显著提升。与此同时，期货公司系统运行压力与风险传导复杂性同步攀升，系统性能容量管理短板导致的网络安全事件时有发生。在此背景下，持续提升系统性能容量管理水平和压力测试有效性，及时发现系统安全隐患，有效防范业务连续性风险，切实保障交易者合法权益，成为期货行业高质量发展的重要保障。

日前，证监会进一步加强工作统筹，指导证券期货行业测试中心（大商所飞泰公司）发挥专业优势，制定《证券期货业交易结算系统压力测试指南》，同时指导协会立足自律管理职能职责制定《管理细则》，通过细化明确交易结算系统压力测试工作要求，形成工作合力，推动行业压力测试科学性、规范性整体提升。

二、主要内容

《管理细则》共十二条，重点从期货公司交易结算系统压力测试的范围、周期、场景、指标、报告等方面做出规定，主要内容如下：

一是明确适用范围与定义，期货公司主席位交易系统（含双活或多活架构）和结算系统的压力测试适用《管理细则》，同时明确了两类系统的定义。**二是建立健全制度机制**，要求期货公司建立压力测试管理制度，明确职责分工和工作流程，保障必要的资源投入，满足压力测试工作开展需要。**三是规范测试周期与测试情形**，除每年至少开展一次常态化压力测试外，将系统变更、行情波动等可能影响系统性能容量的情形纳入压力测试范围。**四是提出测试实施要求**，从测试方案、测试环境、场景数据、测试指标等方面，提出具体工作要求，确保交易结算系统性能容量符合《证券期货业网络和信息安全管理办法》（第218号令）有关规定。**五是明确测试报告要求**，对期货公司压力测试报告的内容要素、审批流程、保存期限及报送时限等做出规定，并由协会对行业整体测试情况开展分析评估。**六是衔接《测试指南》相关场景指标和通过标准**，落实监管工作分工，要求期货公司参照《测试指南》开展基础合规场景测试，同时鼓励公司开展扩展增强场景和推荐补充场景测试，全方位评估交易结算系统的可用性和可靠性。**七是明确自律管理措施**，对于违反《管理细则》的公司和人员，协会视情形予以处理。