

关于发布《郑州商品交易所会员交易信息 系统接入管理办法》的通知

郑商函〔2021〕121号

各会员单位：

为了加强对会员交易信息系统接入活动的监督管理，保障期货市场平稳运行，郑州商品交易所制定了《郑州商品交易所会员交易信息系统接入管理办法》，现予以发布。本办法自发布之日起实施。原《郑州商品交易所远程交易席位管理暂行规定》（郑商发〔2008〕104号）、《郑州商品交易所会员接入和使用交易专网管理规范》（郑商发〔2011〕3号）同时废止。

特此通知。

附件：郑州商品交易所会员交易信息系统接入管理办法

郑州商品交易所

2021年3月23日

附 件

郑州商品交易所会员交易信息系统 接入管理办法

第一章 总则

第一条 为了加强对接入郑州商品交易所（以下简称交易所）的会员交易信息系统的管理，防范接入风险，维护期货市场秩序，根据《期货公司监督管理办法》《郑州商品交易所期货交易细则》及《郑州商品交易所会员管理办法》有关规定，制定本办法。

第二条 本办法所称交易信息系统，是指会员接入交易所从事期货交易业务活动的信息技术系统。

本办法所称外部接入，是指会员通过提供交易信息系统接口或者其他信息技术手段，接受客户交易系统接入，接收客户交易和查询指令的行为。

本办法所称外部接入信息系统，是指通过交易信息系统接口或者其他信息技术手段，接入会员交易信息系统的客户交易系统，处于交易信息系统下级的各类交易系统或终端。

第三条 会员交易信息系统的功能实现、测试要求、网络接入、外部接入以及远程交易席位的申请与接入应当遵循本办法。

第四条 交易所依据本办法对会员交易信息系统的接入

活动实施监督管理，并在中国证券监督管理委员会（以下简称中国证监会）指导下开展相关备案、评估、监测和检查等工作。

第二章 交易信息系统功能要求

第五条 交易信息系统功能设计与技术实现应当遵循业务合规的原则，交易、结算、风险控制、保证金计算等方面应当符合法律、法规、规章、中国证监会的规定以及交易所业务规则。

第六条 交易信息系统应当实现的基本功能包括但不限于账户管理、权限管理、交易管理、行情管理、保证金管理、手续费管理、风险控制等。

风险控制功能应当设计完备、权限清晰，包括但不限于资金验证、持仓验证和流量控制等功能。

第七条 交易信息系统应当具备良好的安全性和稳定性，支持日志记录功能，能够保证业务的连续性和可追溯性。

第八条 交易信息系统应当严格按照交易所交易系统接口开发相关技术要求进行设计开发。交易所接口版本更新的，交易信息系统应当及时更新升级。

第九条 交易信息系统应当满足中国证监会交易终端信息采集相关要求，能够采集、记录、存储和报送其客户交易终端信息，中国证监会另有规定的除外。

第十条 交易信息系统版本发布时，应当按照交易所相关技术要求准确填写交易 API 接口中软件名称和版本号等信息。

第三章 交易信息系统测试要求

第十一条 会员应当建立独立于生产环境的专用交易信息系统开发测试环境，运用交易信息系统从事期货业务活动前应当进行测试。除中国证监会及交易所认可的情形外，会员不得在生产环境开展技术或者业务测试，不得在开发测试环境使用未经数据脱敏的客户信息。

第十二条 会员应当对交易信息系统的合规性、功能性、性能容量、安全规则等进行测试，确认功能符合预期，接口使用符合规范，系统能够稳定运行。测试中发现问题应当及时要求开发主体说明原因并做出相应改进。交易信息系统发生重大变更时，会员应当再次进行测试。

第十三条 交易所对会员交易信息系统接入测试实行申报和报备管理，会员进行交易信息系统接入测试应当提前向交易所申报。

未在交易所报备过的交易信息系统投入使用前，应当在交易所测试环境进行测试；交易信息系统软件版本发生变更的，应当再次在交易所测试环境进行测试。测试通过后应当向交易所报备测试报告。

交易所通过会员服务系统向会员发布已完成报备的交

易信息系统列表。交易信息系统版本已由其他单位完成报备的，无需再次向交易所报备测试报告。

第十四条 会员交易信息系统测试的申报、报备应当包括以下内容：

- （一）交易信息系统的开发主体及软件版本；
- （二）交易信息系统的技术架构及简要说明；
- （三）交易信息系统功能介绍；
- （四）联络人及联系方式；
- （五）测试环境介绍；
- （六）交易功能点测试结果；
- （七）风控功能点测试结果；
- （八）交易所规定的其他内容。

交易所接收、管理会员报备的信息，不代表交易所对会员交易信息系统的合规性、适当性和可用性等作出判断或保证。

第四章 交易信息系统网络接入管理

第十五条 本办法所称交易专网，是指会员交易信息系统接入交易所从事期货交易业务活动的专用网络（不包括会员内部的交易局域网和广域网）。

第十六条 会员交易信息系统应当采用可靠、冗余接入方式接入交易专网。

接入方式包括专线接入、托管接入、集中接入点接入、三所联网接入，以及交易所许可的其他接入方式。

第十七条 会员交易信息系统采用专线接入方式时，应当采用不同运营商的线路作为主、备线路接入交易所。三所联网接入原则上不作为主用接入方式。

第十八条 会员交易信息系统采用托管接入方式时，应当要求托管服务单位采用不同运营商线路作为主、备线路接入交易所，关键设备设施有备份，带宽有冗余。

第十九条 会员应当严格按照交易所相关指引，配置接入交易专网的网络协议和 IP 地址等参数，定期进行接入交易专网主、备通信线路的切换演练。

第二十条 会员启用交易专网接入方式进行交易前，应当向交易所申请进行入网测试，入网测试包括但不限于主用线路测试、网络连通测试、备份线路测试以及交易信息系统测试，测试通过后方可启用。

第二十一条 会员应当专网专用，接入交易专网的线路应当与互联网、办公网和各营业部的内部网络有效隔离，严格控制本单位接入和使用交易专网的终端数量，禁止未经许可的终端接入和访问交易专网。

第二十二条 会员应当对接入交易专网的设备和系统进行安全管理，关闭非必要的端口，定期进行安全扫描和加固。对通过交易专网传输的数据进行检查和过滤，阻止病毒、恶

意代码以及与期货交易业务无关的数据通过交易专网传输。

第二十三条 会员接入交易专网的线路需要移机或者撤销的，应当按照交易所相关工作流程要求，提前向交易所申请和报备。

第五章 远程交易席位申请管理

第二十四条 会员因业务发展、技术托管等需求，可以通过交易所会员服务系统提交远程交易席位的开设、权限变更和撤销等业务申请。

第二十五条 交易所可以根据交易席位使用情况、会员的实际经营状况、违规违约记录和市场情况等决定是否批准会员的远程交易席位申请。

第二十六条 会员申请开设远程交易席位的，应当确保其交易信息系统软件、网络接入已通过交易所测试，并获准接入。

第二十七条 会员申请开设远程交易席位的，除按照《郑州商品交易所期货交易细则》第八条规定提交相关材料外，还应当提交下列材料及信息：

- （一）新申请远程交易席位的权限和席位用途；
- （二）会员接入交易专网通信线路相关信息；
- （三）会员远程交易席位开设地信息；远程交易席位开设在托管机房的，还应当提供托管方的营业执照复印件以及

会员与托管方签订的服务合同复印件；

（四）交易所要求提供的其他材料或信息。

会员应当确保提交的材料及信息真实、合法、完整、有效。

第二十八条 交易所自接收到完整的远程交易席位开设申请材料之日起，10个工作日内完成审核审批，并将审批结果通过会员服务系统反馈给会员。

第二十九条 会员申请撤销远程交易席位或者变更远程交易席位权限的，应当通过会员服务系统提交申请。交易所审批同意后，撤销相应交易席位或者变更相应交易席位权限。

第三十条 远程交易席位的交易信息系统、席位位置、IP地址等信息发生变更的，会员应当自变更之日起三个工作日内在会员服务系统中更新报备相关信息，并保证填报信息与实际情况一致。

第三十一条 会员远程交易席位使用费由交易所另行通知。

第六章 远程交易席位接入管理

第三十二条 会员应当严格按照交易所相关指引进行远程交易席位接入参数配置，并妥善保管接入参数信息。

第三十三条 会员应当指派远程交易席位应急联络人并向交易所报备，应急联络人发生变动的，应当及时更新报备

信息。

第三十四条 会员不得违规接入未经测试报备的交易信息系统，不得在交易期间接入交易所生产环境进行测试。

第三十五条 会员远程交易席位及相关网络严禁用于任何可能对交易所交易系统产生危害的行为。

第三十六条 会员应当参与交易所组织的业务测试和应急演练，并按要求提交反馈报告、保存相关记录。

第三十七条 会员应当确保交易申报指令报入交易所交易系统前经过会员交易信息系统风险控制功能的前端检查，不得关闭或者绕过风险控制功能，不得以技术手段规避检查。会员应当建立相应的日志留痕机制，日志留存的具体时限参照行业有关规定执行。

第七章 交易信息系统外部接入要求

第三十八条 会员开展交易信息系统外部接入活动应当遵循以下原则：

（一）合规审慎原则。会员应当审慎评估客户交易需求的合理性，提供与其合理交易需求相匹配的交易信息系统外部接入服务。

（二）风险可控原则。会员应当识别、监测和防范交易信息系统外部接入的风险隐患，采取有效管控措施和技术手段及时阻断风险传导，维护期货市场秩序。

（三）全程管理原则。会员应当对交易信息系统外部接入加强管理，建立健全明确、清晰的全流程管理机制，包括但不限于尽职调查、事前审查、交易监测、异常处理、应急处置和退出机制。

第三十九条 会员向客户提供外部接入服务的，应当与客户签署协议，明确双方权利、义务和责任。

第四十条 会员应当就开展交易信息系统外部接入活动涉及的相关信息做好留档，并根据交易所相关要求及时进行报告。

第四十一条 会员应当建立测试环境，在提供外部接入前或外部接入信息系统发生较大变更时，应当对外部接入信息系统进行合规、风险评估和技术系统测试，确认功能符合预期，接口使用符合规范，系统能够稳定运行。发现问题的，应当及时要求外部接入信息系统提供方说明原因并做出相应改进。

第四十二条 会员不得为违规接入交易信息系统提供任何便利和服务，不得将本机构交易信息系统及终端的管理权限交给客户，也不得将外部接入信息系统直接接入交易所交易系统。

第四十三条 会员应当建立完善的交易信息系统外部接入异常交易处理机制，必要时应当采取限制接入、暂停接入等措施。

第四十四条 会员发现客户违反期货相关法律法规或者存在重大风险隐患的，应当终止向其提供交易信息系统外部接入服务，并及时向交易所报告。

第八章 监督管理

第四十五条 交易所可以对会员交易信息系统接入活动实施现场检查和非现场检查，会员应当予以配合。

第四十六条 会员应当确保其所申报的信息真实、准确、完整，承诺其所使用的交易信息系统符合法律、法规、规章以及交易所业务规则的规定。

第四十七条 会员应当对开发、测试和接入等过程中获悉的交易所尚未正式对外公开的数据、信息等进行保密，除法律、法规、规章或者交易所业务规则另有规定外，不得披露或者转让给第三方使用。

第四十八条 会员未按要求接入交易信息系统，或者有其他可能影响交易所交易系统安全行为的，交易所可以采取限制或者暂停会员交易席位接入等措施。

第四十九条 会员违反本办法的，交易所可以按照《郑州商品交易所违规处理办法》有关规定，给予相应的自律监管措施或者纪律处分。

第九章 附则

第五十条 本办法解释权属于郑州商品交易所。

第五十一条 本办法自发布之日起施行。《郑州商品交易所远程交易席位管理暂行规定》（郑商发〔2008〕104号）、《郑州商品交易所会员接入和使用交易专网管理规范》（郑商发〔2011〕3号）同时废止。