



增强行情非展示数据 技术规范

(V1.3)

二〇二二年九月

一、概述

为更好地支持证券公司等机构客户的业务发展，深圳证券交易所（以下简称深交所）允许证券公司等机构客户（以下简称客户）在符合条件的机房规范地使用深交所增强行情非展示数据，供客户内部业务使用或为其转发用户提供服务。

为保障系统安全运行、规范数据使用和维护市场公平，特制定增强行情非展示数据服务技术管理规范。所有使用深交所增强行情非展示数据的客户，应根据本指引不断建立和完善信息服务系统、运行监控系统和运行环境保障系统，完善安全运行保障组织结构和应急处理流程，提高风险预警能力，提高异常处理能力，建立高品质的增强行情非展示数据技术服务。本规定解释权归深圳证券信息有限公司（以下简称信息公司）所有，信息公司有权根据实际情况对本规定进行调整变更。

二、机房标准

客户所使用增强行情非展示数据服务的数据中心建设整体标准应满足电信行业四星级标准（具体请参见附件一）。

三、技术管理组织结构

1. 客户应建立专门的保障安全运行的组织结构，定义清晰明了的团队成员的岗位和职责，领导层应直接负责安全生产。安全运行团队负责整个安全生产保障制度的建立和管理并文档化。客户应根据自身业务

的发展和技术的发展持续改进安全运行队伍。

2. 安全运行团队应该包括日常系统运行操作与监管人员、异常处置人员、技术支持人员和危机公关人员以及相应的管理人员。关键岗位还应采取备岗制度。

3. 涉及系统运行的风险操作，必须设置两个（操作和复核）或者以上环节，并由不同的人员分别完成。

4. 运维团队应致力于建立电子化监控和电子化管理的系统来进一步协助和完善系统运维，确保生产安全。

5. 运维团队应建立应急联系通讯录，标明 24 小时可联系的联系方式，通讯录应分发到所有成员。

6. 相关岗位人员应定期的参与相关业务和技术知识的培训；运行团队的成员离岗必须严格进行技术和安全运行工作方面的交接，交接人员应共同工作不少于 10 个工作日。

四、安全运行保障制度

1、客户应建立安全运行例会制度，定期通报安全运行情况，落实保障措施，通报安全生产中存在的问题，解决可能潜在的风险。举行例会的时间间距原则上不超过 2 周。

2、建立安全运行特别保障制度，在遇到突发事件或突发情况时，启动不同级别的特别保障期，保障期一般为事件发生时开始启动，至事件结束时终止。特别重要的，当深交所启动相应的保障机制时应启动不低于深交所保障级别的保障机制。启动特别保障时，关键岗位人员

不得离岗，技术支持团队应能够随时到位予以支持。

3、建立完善的应急预案和处置流程，明确日常关键操作的操作手册并按册操作和复核，出现异常状况时根据应急预案和处置流程进行处置。运维团队应持续改进应急措施并形成操作指引，完善应急预案和处置流程。

4、建立《硬件及系统环境变更实施管理规范》和《应用变更实施管理规范》，未经安全运行负责人许可，任何人员不得对机房内的硬件设备、网络环境、各类系统软件和应用软件等要素进行变更操作，任何变更操作必须按照系统的规定进行。

5、应定期的收集系统负荷相关的指标、建立相应的监控模型并根据分析结果改进软硬件系统性能。建立软硬件定期巡检和定期升级制度。涉及到实时行情运行的系统，应建立日常现场监视制度，日常巡视应按照既定的操作表来逐项检查并记录，在交易时间内不少于 4 次收集 CPU、内存、网络状态、硬盘空间等系统负荷相关的数据。

6、客户应统计安全生产月报。包括服务器性能指标、系统运行状态、升级与操作日志以及下一步建议等。

五、系统建设和应用指引

（一）基本要求

1、客户应采取安全防范措施，防止应用系统遭到外界入侵和攻击。对于数据使用情况相关的数据采必需能够提供足够的保护来防止被篡改。系统也应具备良好的防止非法盗用信息的安全措施，传输和存

储采用有效的加密手段应该是必要的技术保障手段。客户与深交所直连的网络、主机和应用应符合《信息安全技术 网络安全等级保护基本要求》的第二级安全要求。

2、所有系统应采用成熟的体系结构，具备良好的设备冗余能力。信源的接入和处理以及发布都不应存在单点故障。同时系统也应建立良好的备份和恢复机制。

3、系统运行的机房有专人负责系统设备管理。未经安全运行责任人许可，非运维团队人员不得在系统所在的设备上做任何操作，设备供应商对机房设备的例行维护原则上选择在周末、假期等非交易日进行。

4、所有系统的上线或者升级，应经过严格的测试并提交完整的测试报告和运维操作手册，并对运维操作人员进行培训。升级操作并须首先被清晰的定义并且在操作过程中按照手册步骤进行，操作手册也应包括升级前的备份措施和失败后回滚的恢复步骤。

5、客户应申请低延时高保障的线路，并对网络及增强行情数据进行监控，确保数据接收品质。

6、客户应设置业务连续性及可用性指标，并采取相应的措施进行落实。

7、客户指定机房在中国证券期货业南方信息技术中心以外的，每个指定机房应至少有 1 条专线连接托管在南方中心的增强行情服务器。

8、客户自用及转发用户的应用系统在增强行情数据不能正常服务时，应具备切换到 Level-1 数据的能力。

9、客户需保留对外网络设备的传输日志，信息公司有权对增强行情

数据对外传输情况进行检查、审计。

（二）数据自用

- 1、客户可在信息公司认可的机房内，使用增强行情非展示数据用于自身业务的内部系统。
- 2、客户指定机房不是深证通南方中心的，托管在南方中心的服务器除部署行情网关程序和压缩程序外，不得部署其他应用程序。
- 3、客户按合同要求对使用增强行情非展示数据的系统进行管理，具备用户登录权限控制与监管的功能，实时统计系统操作终端的数据量，并可对终端总数进行有效控制，记录并保留终端使用情况以备信息公司检查。
- 4、客户的自用系统应当避免单点故障，当增强行情数据传输出现问题时能自动切换到 Level-1 数据，提高服务的连续性。
- 5、客户不得使用任何数据接口方式，将增强行情数据传输到机房外。
- 6、客户可以将操作终端必须使用的部分增强行情数据传输到机房外的操作终端，但传出数据内容及频率等必须报备信息公司。
- 7、客户操作终端获取的增强行情数据仅限操作终端使用，不得有增强行情数据的导出功能。

（三）数据机房内转发

- 1、客户可在信息公司认可的机房内，将增强行情非展示数据转发给其用户使用，用户的业务系统必须部署在同一机房内。
- 2、客户指定机房不是深证通南方中心的，托管在南方中心的服务器除部署行情网关程序和压缩程序外，不得部署其他应用程序。

- 3、行情转发系统应具备保障数据完整性、实时性的技术措施，数据的处理和分发应采用低时延策略。
- 4、客户应为转发用户提供至少一路增强行情数据和至少一路 Level-1 数据。
- 5、用户只能在客户指定机房内的系统中使用增强行情数据，不得将任何数据，以任何方式传到机房外。
- 6、用户须通过客户行情转发系统获取增强行情数据，转发系统应具备权限控制功能。客户不得以任何方式绕过行情转发系统将行情数据提供给用户，包括但不限于光分器、行情镜像等方式。
- 7、客户建立转发用户管理系统，记录用户信息，每月提交用户月报，并保留所有转发用户的使用情况以备信息公司检查，用户信息需保留 5 年以上。

六、应急预案和处置流程

- 1、建立完整的系统运维操作手册，包含日常问题的处理操作，操作人员必需严格按照既定的程序、时间、场所，准确、及时完成操作并留痕，操作手册应根据现状进行持续改进。未定义的操作步骤应启动应急处置流程进行处理，严禁擅自操作。
- 2、异常处置是指针对影响系统正常运行的问题发生时所启动的操作步骤，客户应对潜在的异常情况进行清晰的定义并根据影响结果的不

同建立应急处置流程，流程应明确汇报关系和决策人，操作环节。通常在交易时间发生的异常属于紧急异常，紧急异常发生时，允许采用口头商议和决策的方式，事后补办书面处理文档。

3、异常处理应提交异常分析和异常处理报告。造成重大事故的，应成立分析鉴定小组，分析鉴定小组提出的分析鉴定结论，应包括异常事件是否存在人为责任的判断、责任事故的原因和过程、责任事故级别、主要责任人和次要责任人、责任人的主观过错程度以及是否存在免责或减责的情形等内容。

4、造成对外服务影响的异常，在异常处理中应第一时间启动危机公关，危机公关团队应对外进行异常说明和发表致歉说明。

5、造成对外服务影响的异常发生后应第一时间通知我公司，异常处理报告完成后应抄送我公司备案。

七、转发用户管理

客户应建立转发用户管理系统，对数据转发用户进行有效的管理。

（一）转发用户详细信息

用户管理系统应该可查询过去 5 年内每个用户的详细信息，信息公司可以查阅相关的明细数据，数据内容包括但不限于：

1. 用户 ID：用户在系统中的唯一标识，用户使用该标识登录系统
2. 用户名称：用户向乙方申报的注册名称（应填写其在法定注册机构上登记的名称）
3. 用户类型：何种机构

4. 数据用途：数据使用用途
5. 服务状态：包括正常使用、服务到期、用户注销等状态
6. 服务起始日期
7. 服务终止日期
8. 联系地址
9. 联系人
10. 联系电话
11. 电子邮箱

（二）转发用户月报

每月转发用户统计信息，可查询过去 5 年内每个月的用户统计信息，包括如下内容：

1. 日期
2. 当月开通服务的用户数
3. 当月终止服务的用户数
4. 当月期末用户数
5. 转发用户数量统计规范
 - 1) 新用户：是指开通日期在上月的授权用户。
 - 2) 续延用户：是指开通日期早于上月且截止日期晚于上月的授权用户。
 - 3) 超期终止用户：是指开通日期早于上月且截止日期在上月，但截止时间所在月份授权天数大于开通时间所在月份未授权天数加一的用户

当月统计用户数量为以上三类用户数量之和。

附件一：数据中心建设标准

1	物理位置的选择 (G2)	a) 机房和办公场地应选择在具有防震、防风和防雨等能力的建筑内;
2	物理访问控制 (G2)	a) 机房出入口应安排专人值守, 控制、鉴别和记录进入的人员; b) 需进入机房的来访人员应经过申请和审批流程, 并限制和监控其活动范围。
3	防盗窃和防破坏 (G2)	a) 应将主要设备放置在机房内; b) 应将设备或主要部件进行固定, 并设置明显的不易除去的标记; c) 应将通信线缆铺设在隐蔽处, 可铺设在地下或管道中; d) 应对介质分类标识, 存储在介质库或档案室中; e) 主机房应安装必要的防盗报警设施。
4	防雷击 (G2)	a) 机房建筑应设置避雷装置; b) 机房应设置交流电源地线。
5	防火 (G2)	a) 机房应设置灭火设备和火灾自动报警系统。
6	防水和防潮 (G2)	a) 水管安装, 不得穿过机房屋顶和活动地板下; b) 应采取措施防止雨水通过机房窗户、屋顶和墙壁渗透; c) 应采取措施防止机房内水蒸气结露和地下积水的转移与渗透。
7	防静电 (G2)	a) 关键设备应采用必要的接地防静电措施;
8	温湿度控制 (G2)	a) 机房应设置温、湿度自动调节设施, 使机房温、湿度的变化在设备运行所允许的范围之内;
9	电力供应 (A2)	a) 应在机房供电线路上配置稳压器和过电压防护设备; b) 应提供短期的备用电力供应, 至少满足关键设备在断电情况下的正常运行要求。
10	电磁防护 (S2)	a) 电源线和通信线缆应隔离铺设, 避免互相干扰;
11	其他	a) 机房应安排有专职24小时值班网管 b) 机房建设整体标准应满足电信行业四星级标准