

深交所技术发展简报

喻华丽

2011-6-14

提 纲

- 一、深交所与FIX
- 二、2011-2013年技术发展

1.1 深交所与FIX

- 2002-2004：参与FIX本地化版本STEP协议的制订工作
- 2005/03/25：STEP 1.0 正式发布
- 2006：支持STEP1.0的深市STEP协议引擎由深圳证券通信公司开发完成
- 2008/10：深市level 2行情系统内部试运行，STEP正式应用于生产系统
- 2011/5/30：深市level 2行情系统增加FAST协议支持

1.2 应用现状

- 目前限于在行情系统中使用，交易环节尚未使用
 - 我所新版交易系统将增加对STEP协议的支持
- 本地化版本 vs FIX标准协议
 - 国内证券业务的差异性
 - 标准协议无法支持部分业务
 - 本地化如何保持与FIX的发展同步？
 - 新业务持续发展，现有STEP版本已经存在局限
 - 证标委已启动修订项目

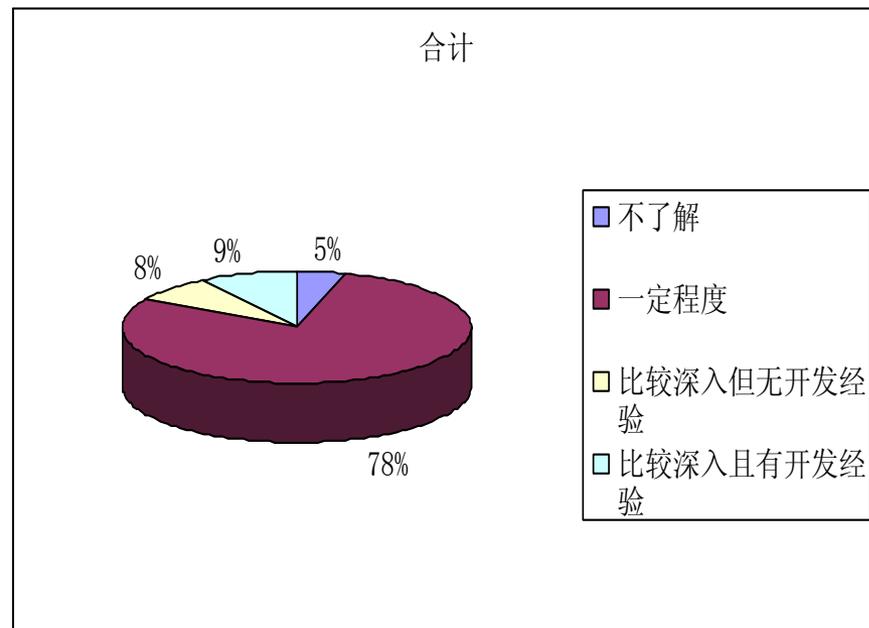
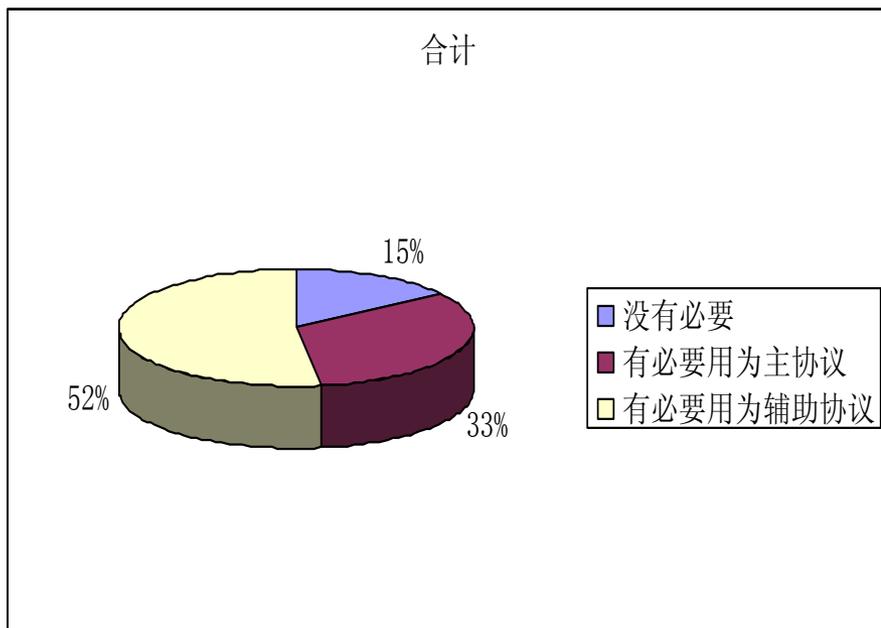
1.3 新版交易系统STEP应用计划

- 我所准备建设新版交易系统，目前已基本完成规划工作
- 新版交易系统将增加对STEP协议在交易环节的支持
- 针对接口，组织了市场需求调研

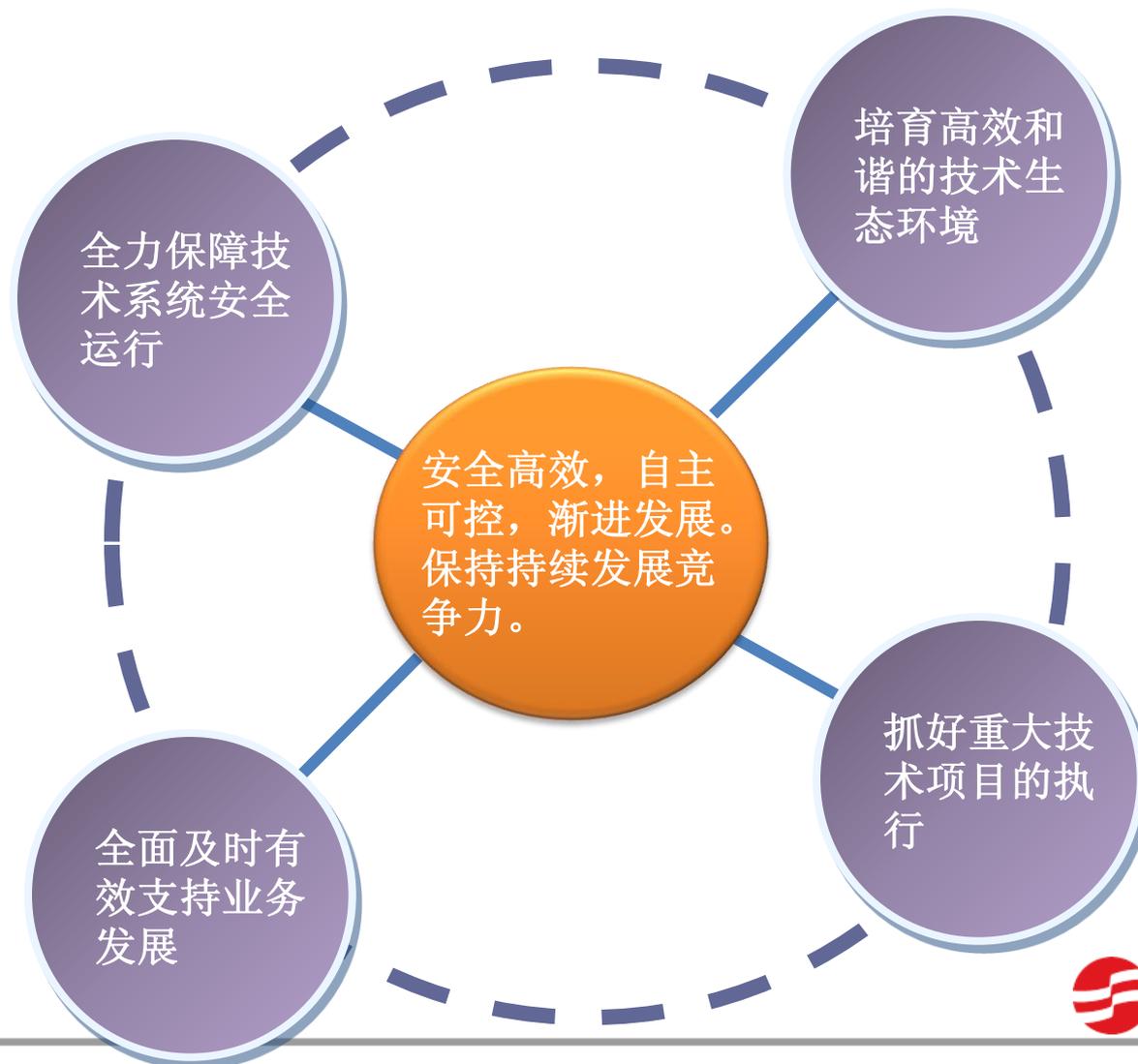
1.3 新版交易系统STEP应用计划

■ 引入STEP/FIX接口？

■ 对STEP了解的程度



2.1 技术发展思路



2.2 2011年工作重点

- 1、协议交易平台电子接口
- 2、证券数量扩容
- 3、提高基本行情发布频率
- 4、支持融资融券转融通等业务创新
- 5、新技术中心交易系统平台升级
- 6、启动第五版交易系统建设实施

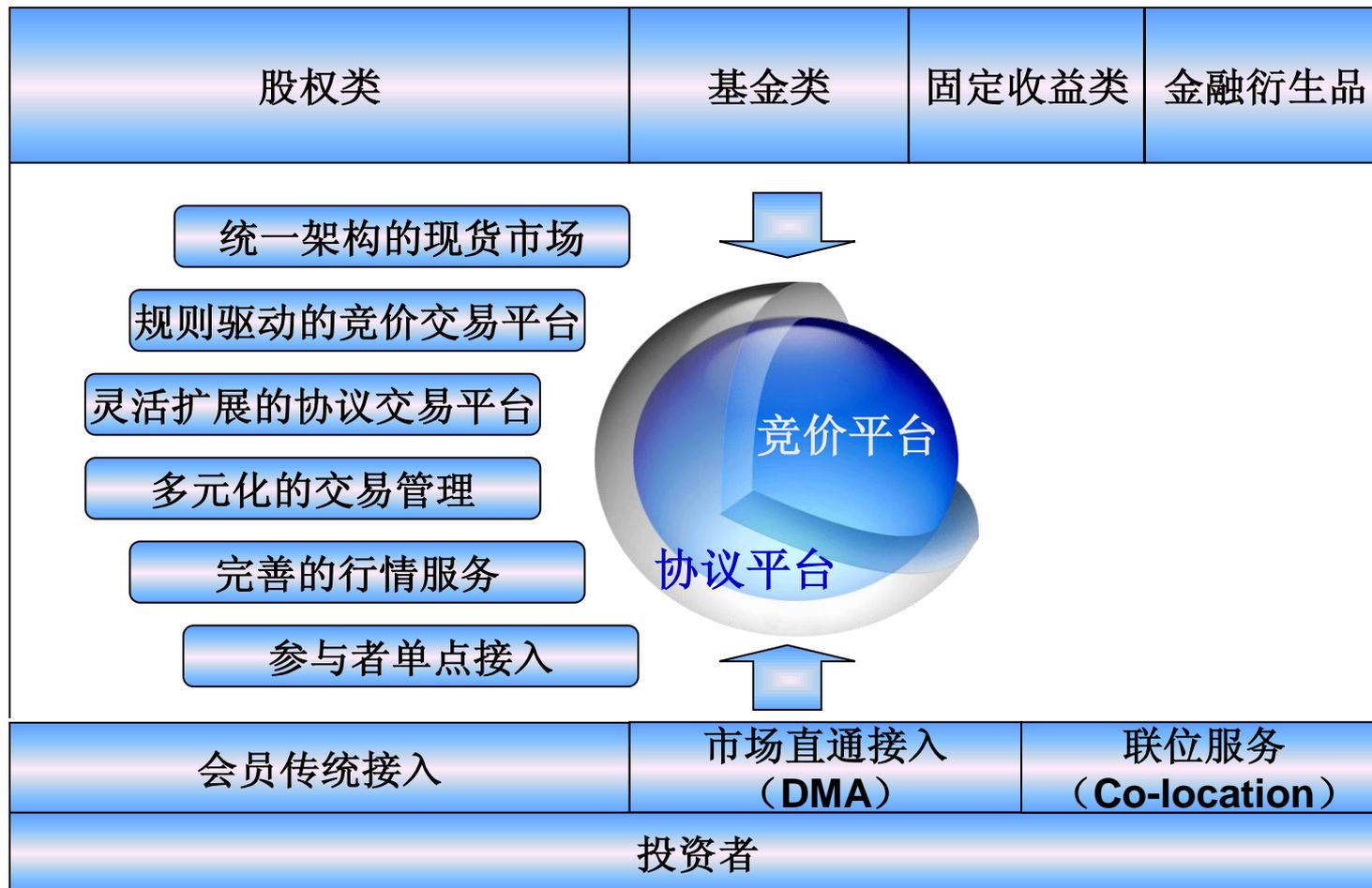
2.2.1 新技术中心交易系统平台升级

指标	当前系统	新技术中心交易系统 升级扩容目标
一、Throughput		
持续订单处理速度	4万笔/秒	8万笔/秒
二、Latency		
国际同比时延（内部）	35ms	35ms
三、日处理委托笔数	7000万笔/天	9000万笔/天
四、日处理成交笔数	5000万笔/天	6000万笔/天

2.3 2011-2013年技术发展

- 1、第五版交易系统建设实施
- 2、两地三中心建设

2.3.1 第五版交易系统建设



2.3.1 第五版交易系统建设

容量/性能指标	新技术中心 交易系统	第五版交易系统 规划目标
日处理委托	9000万笔	3亿笔
交易证券数	5000只	10000只
持续订单处理能力	8万笔/秒	20—30万笔/秒
委托处理延迟	35毫秒	5—10毫秒
券商端交易时延	110毫秒	<100毫秒
网关报盘速率	2000笔/秒	5000笔/秒

2.3.2 两地三中心建设



- 交易、结算、通信集中运行
- 本地两中心：建议新一代数据中心
- 在郑州设立异地灾备中心

Thank You!

