

深圳证券交易所最新技术规划

喻华丽 总监

深圳证券交易所 技术规划部

内容提要

- **FIX在深圳市场的应用规划**
- **深交所近期技术发展规划**

一、FIX在深圳市场的应用规划

FIX在深圳市场的应用规划

■ 深交所与FIX协议

- ☞ 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
- ☞ 2012/3：参与STEP协议修订

FIX在深圳市场的应用规划

■ STEP协议修订内容

☞ 业务支持修订

- 创新业务方面主要有，增加个股期权业务；报价回购及约定购回业务；转融通业务；删除证券行情广播消息，增加FIX标准的行情广播消息，以支持FAST行情。
- 其他累积新增的主要有：网络投票业务；权证行权；权证创设、注销；ETF申购赎回；ETF保证金申购、补券；开放式基金认购、申购、赎回、分红选择、份额转入、转出、基金转换；质押债券入库、出库；配股行权；可转债转股转换、回售；市值配售放弃认购；预受要约、解除预受要约；融资融券业务；市场行情消息；大宗交易业务。

☞ 新版本和优化修订

- 将结合国内应用情况，讨论研究删除一些消息和定义，简化定义方法，更新版本号，并在协议本土化方面做进一步探索研究。

FIX在深圳市场的应用规划

■ 未来深圳市场STEP应用

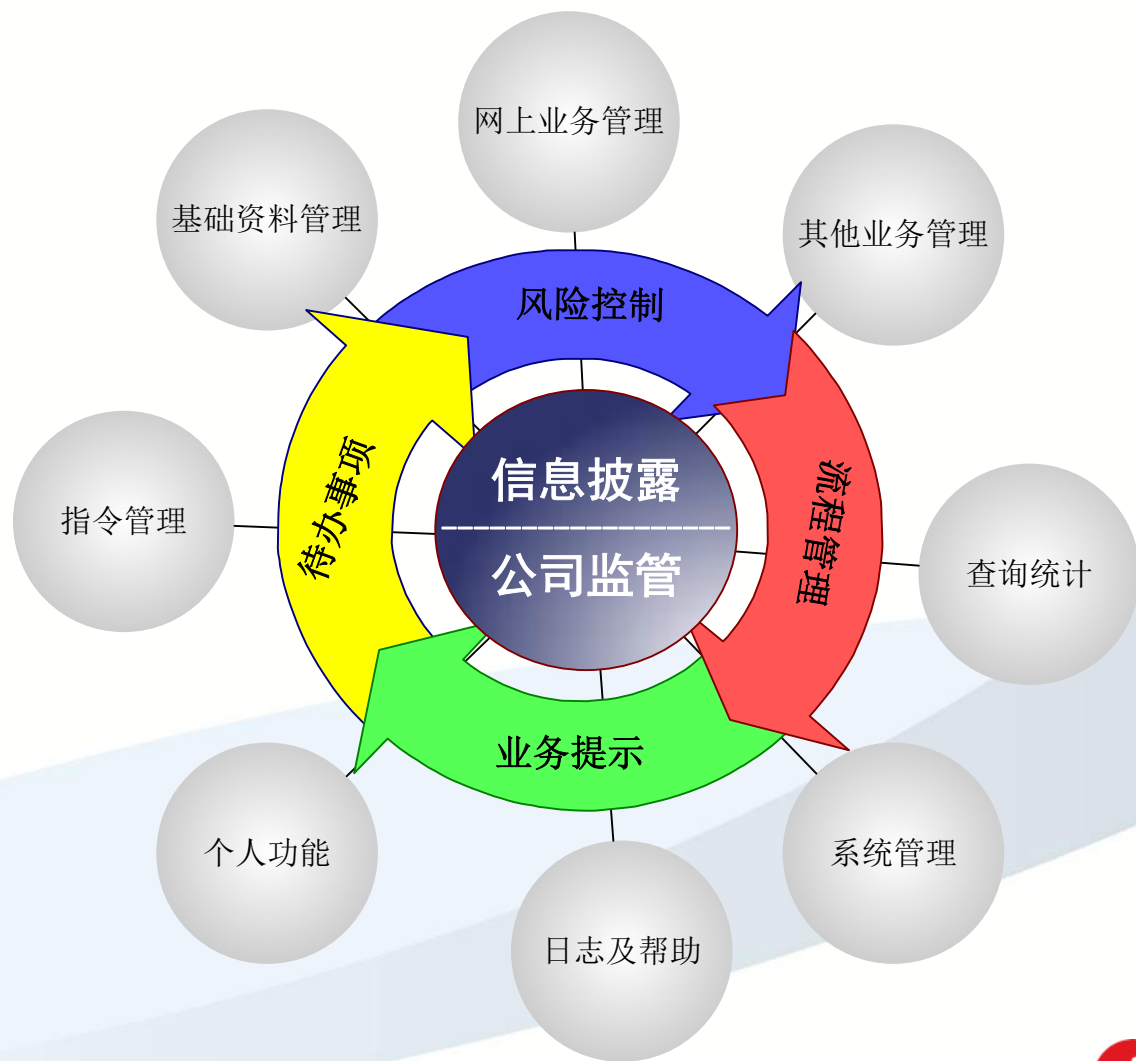
- ☞ 提供支持STEP修订后的协议引擎
- ☞ 我所新行情系统继续支持STEP协议
- ☞ 新版交易系统将增加对STEP协议在交易环节的支持

二、深交所近期技术发展规划

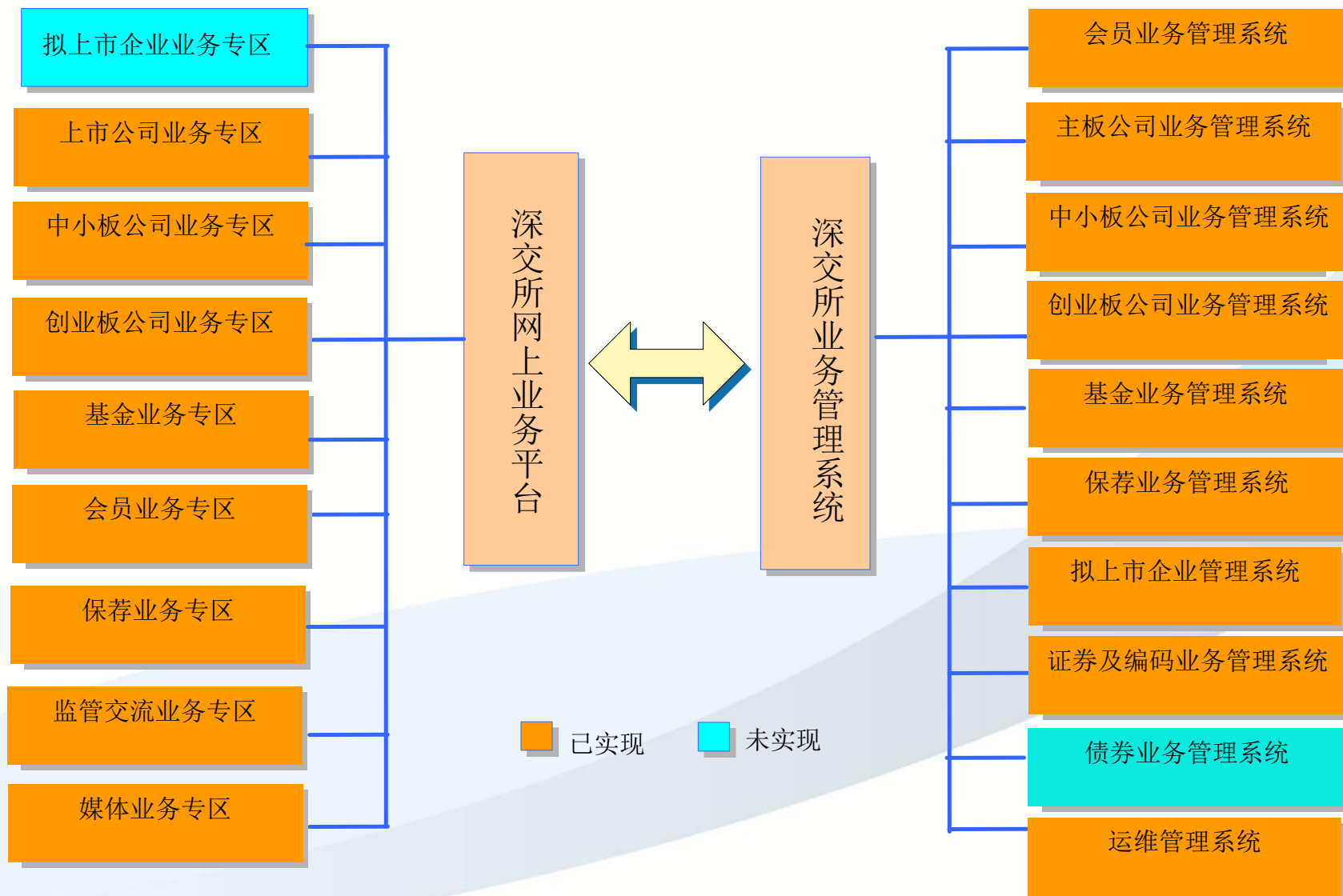
2012年主要技术更新

- 协议交易平台电子接口
- 转融通业务技术系统
- 港股ETF
- 债券制度改革（债券T+0出入质押库，二级监控，标准券并库）
- 业务流程管理四期系统完成并上线
- 新大楼技术中心建设
- 第五版交易系统一期项目建设

上市公司业务管理系统（BPM4）上线



业务流程管理系统（BPM）组成



未来三年技术规划

■ IT使命

推动交易所信息化，有效整合内部资源，保障业务安全和持续运营，快速灵活支持业务创新，提高监管、服务的质量与水平，控制和降低运营成本，提升交易所竞争力。

■ IT愿景

营造积极和谐的技术生态环境，全面支持业务发展，保持国内领先，创造东亚一流的技术优势，有力支撑多层次资本市场发展战略。

■ IT文化

团结协作 · 务实进取 · 追求卓越 · 共同成长

未来三年技术规划

■ IT组织运作机制完善

- ➡ 规划、研发、运维三位一体的组织架构
- ➡ IT服务管理体系升级

■ 优化目标：一体化的IT服务

- ➡ 技术与业务协同发展
- ➡ 提高交付能力
- ➡ 提高IT资源使用效率
- ➡ 控制IT风险

未来三年技术规划

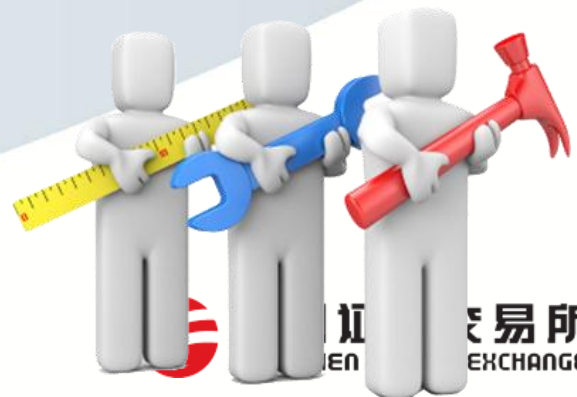
■ 技术系统持续优化建设

- 👉 及时满足业务发展需求
- 👉 新大楼技术中心平稳切换
- 👉 提高系统灾备能力，满足行业核心机构备份能力建设要求
- 👉 建设集中、完备的独立测试环境，提升测试质量
- 👉 提高运维管理水平，实现系统运维集中监控和集中告警

未来三年技术规划

■ 重点工程项目

- ➡ 新大楼技术中心建设
- ➡ 现有交易系统持续完善
- ➡ 第五版交易系统建设



新大楼技术中心建设

■ 新大楼技术中心机房建设

- ☞ 总体按计划有序推进
- ☞ 预计2012年底完成

■ 新大楼技术中心技术系统建设

- ☞ 2012年完成统一部署规划
- ☞ 2013年上半年准备就绪

新大楼技术中心效果图



现有交易系统持续完善

实施路径上，交易系统的发展是两条腿走路，在建设第五版系统的同时，我们也在不断的完善现有系统，支持这几年的市场需要

业务持续支持（跨境ETF、约定购回、报价回购、牛熊宝、…）

技术优化（性能优化、灾备建设、主机升级、…）

2011.11

2015.11

现有系统优化

第五版系统建设

持续发展

2011.11

2015.11

项目准备

项目实施

切换上线

第五版交易系统建设


■ 项目目标

- ☞ 建设具有更高的效率、容量和安全性，更强的可扩展性、业务适应性，更科学合理架构，能支持多层次、多品种、跨市场的一体化集中交易系统，以满足中国证券市场未来10-15年的发展需求
- ☞ 高可用、高性能、低时延、易扩展、易操作、成本效益高的集中交易平台

第五版交易系统实施计划



第五版交易系统实施目标

	现有系统	第五版交易系统
处理速度 	4万笔/秒	20-30万笔/秒
处理时延 	35毫秒	5-10毫秒
支持证券数 	5千只证券	5万只证券

Thank You!

