

上证所 Level-2 行情应急场景及处置要求

文档 状态	☐ 初稿	文档标识	上证所 Level-2 行情应急场景及处置要求
	☐ 评审通过	当前版本	1.0.0
	☐ 修改	作 者	市场数据部
	☒ 发布	发布者	上证所信息网络有限公司
	☐ 作废	完成日期	2023/02/01

文档变动说明

日期	版本	说明
2023-02-01	1.0.0	首次发布

1. 背景

为提高下游信息商在行情系统安全风险方面的防范意识,检验各信息商技术系统应急处置能力,增强联合应急演练和应急处置能力,提升应急保障水平,制定 Level-2 行情应急场景。

2. 适用对象

本应急场景及处置要求适用于本所 Level-2 展示用户、Level-2 非展示用户及其他使用本所 Level-2 行情的用户。

3. 应急场景

应急场景中涉及的切换时间要求从 LDDS 系统行情异常发生时间算起,恢复时间要求从 LDDS 系统行情恢复时间算起。

3.1 行情源接入异常

应急场景	该类异常包括如下场景: 1、单路 Level-2 行情源接入异常,如无法接入、中断或丢包严重 2、双路 Level-2 行情源接入异常,如无法接入、中断或丢包严重
预计发生时间	盘前、盘中
对信息商系统的预期	1、Level-2 行情单路接入异常时,信息商系统应能正常对外服务 2、竞价 Level-2 行情双路均接入异常时,信息商系统能够在 30 秒内切换至 Level-1 行情对外提供服务,并对外发布市场通知 3、部分 Level-2 行情源接入异常时,信息商可根据自身系统特性采取适当服务模式,但要求对用户展示正确的行情数据

3.2 认证及回补服务异常

应急场景	该类异常包括如下场景： 1、VDE 认证服务异常 2、Level-2 逐笔数据回补服务异常
预计发生时间	盘前、盘中
对信息商系统的预期	1、信息商系统应具备切换认证及回补服务的能力，主用服务发生异常时，能够切换到备用服务 2、双路认证服务均异常时，信息商可通过其他渠道和方式为用户提供正常的行情服务，如无法提供行情服务，应及时通知用户，并做好应急公关工作 3、双路回补服务均异常时，信息商可于回补服务恢复后或盘后再进行数据回补，回补服务的暂停应不影响其他行情正常服务

3.3 行情源数据异常

应急场景	该类异常包括如下场景： 1、静态数据异常 2、实时行情异常
预计发生时间	盘前
对信息商系统的预期	1、信息商系统应具备及时发现异常的能力，并在交易所发布正确数据后，及时修复处置 2、信息商系统应具备切换服务的能力，在行情发生异常时，能够通过各种渠道和方式为用户提供正常的行情服务（可降级服务），如无法切换，应向市场明确说明暂停服务 3、信息商系统应具备个别消息切换的能力，如不具备，在异常发生时，应将所有服务均做切换，确保为用户提供完全准确的数据 4、信息商系统应具备暂停个别消息的能力，在个别消息发生异常时，不影响其他服务

3.4 信息商系统异常

应急场景	该类异常为行情源发布正常，信息商自身系统发生异常，包括如下场景： 1、自身系统运行异常 2、自身系统处理后数据异常
------	---

预计发生时间	盘前、盘中
对信息商系统的预期	1、信息商系统应具备及时发现异常的能力 2、信息商系统异常发生时，及时通知我司 3、若 Level-2 行情异常且无法恢复，需要在 10 分钟内切换到 Level-1 行情对外提供服务 4、若 Level-2 和 Level-1 行情均异常，信息商应及时通知用户，并做好应急公关工作；行情恢复后，信息商应在 10 分钟内做好行情恢复工作