上海东方期货经纪有限责任公司

程序化交易报备办法

|  |  |
| --- | --- |
| **制 订:** |  |
| **审 核:** |  |
| **批 准:** |  |

文档属性

|  |  |
| --- | --- |
| 文件属性 | 内容 |
| 文件名称 | 程序化交易报备办法 |
| 文件编号 |  |
| 文件版本号 | V1.0 |
| 文件状态 | 已审核 |
| 作 者 | 王迪 |
| 文档编写日期 | 2019-05-30 |
| 文档发布日期 | 2019-05-31 |

文档变更历史清单

|  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- |
| 文件版本号 | 修正日期 | 修正人 | 备 注 |
| V1.1 | 20190624 | 杜啸冰 | 修改报备表中系统接入方式等内容 |
|  |  |  |  |
|  |  |  |  |
|  |  |  |  |

本次修改变更说明

|  |  |
| --- | --- |
| 序号 | 变更内容简述 |
|  |  |
|  |  |
|  |  |
|  |  |
|  |  |
|  |  |
|  |  |
|  |  |
|  |  |
|  |  |
|  |  |
|  |  |
|  |  |
|  |  |
|  |  |
|  |  |

**上海东方期货程序化交易报备办法**

根据中国证券监督管理委员会、上海期货交易所、上海国际能源交易中心、郑州商品交易所、大连商品交易所、中国金融期货交易所等有关通知的精神，为进一步规范期货公司客户使用程序化交易系统进行自动化交易，协助监管机构维护市场正常交易秩序，决定自本办法发布之日起对程序化交易客户实行报备。

一、客户应事先向我司上报使用“由计算机按照事先设定的具有行情分析、风险管理等功能的交易模型，自动下达交易信号或报单指令”程序化交易软件的相关信息。

二、我司官网提供的交易终端软件不在本次报备范围内。

三、客户应如实填写《程序化交易软件使用情况报备表》（见下页或从公司网站下载），并通过书面方式向我司报备。

四、客户若存在不报、漏报、未及时报备程序化交易的情况，将可能被监管部门采取谈话提醒、书面警示、限制期货业务等措施，由此带来的损失将由客户自行承担。

五、我司将根据客户填写的书面报备材料，及时在交易所会服上通过会员服务系统完成报备工作。

**程序化交易软件使用情况报备表**

|  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- |
| 投资者名称 | 　 | 投资者代码 | 　 |
| 投资者类型： |  □自然人 □法人 □特法 □资管 |
| 联系电话 | 　 | 邮箱 |  |
| 交易地点 | 省 市 区 |
| 主要交易品种 |  |
| 交易品种所属 | □上期所 □大商所 □郑商所 □能源中心 □中金所 |
| 交易模式（可多选） | □ 日内高频交易： □ 人工下单 □ 软件自动下单□ 日内非高频交易： □ 人工下单 □ 软件自动下单□ 隔夜交易 □ 组合交易□ 其他类型（填写）： |
| 软件名称版本 |  |
| 软件来源/维护（单选） | □期货公司提供□客户自行开发□客户购买（请注明开发商）： |
| 基本功能：（可多选） | □自动开/平仓 □批量下单功能 □风险控制/辅助功能□日内短线 □组合/条件/预埋单□套利/组合套利□交易模型编写 □多账户管理 □止盈/止损功能□其他功能： |
| 交易策略说明： |  |
| 软件来源选项为【客户购买】【客户自行开发】的请填写以下项目 |
| 系统接入方式（单选） | □期货公司托管□软件商自管，专线接入 □软件商自管，互联网接入□客户自管，专线接入 □客户自管，互联网接入 |
| 允许其他程序再次接入 | □是 □否  |
| 具有多交易员管理的功能 | □是 □否  |
| 其他备注： |  |
| 本人(单位)承诺以上报备信息属实。客户签字(盖章)：　　　　　　　　　年　 月　 日 |