附件：

股指期权合约交易信息报备表

|  |  |  |  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- |
| 会员名称 |  | | | 会员号 | | |  | |
| **客户信息** | | | | | | | | |
| 客户名称 |  | | | 客户号 | | |  | |
| 身份证或开户有效证件或机构组织代码 |  | | | | | | | |
| 联系人电话 |  | | | 联系人邮箱 | | |  | |
| 客户类型 | □个人客户 □一般机构  □券商自营 □券商集合理财  □公募基金 □公募专户  □保险产品 □信托产品  □私募基金 □其他（请填写） | | | | | | | |
| 资产规模 | （万元） | | | 期权交易资金规模 | | | （万元） | |
| **交易相关信息** | | | | | | | | |
| 是否使用托管机房 | □ 是 □ 否 | | | 托管机房名称 | | |  | |
| 席位编号 |  | | | | | | | |
| 订单申报峰值 | 笔/每秒 笔/每天 | | | | | | | |
| 交易模式 | □ 人工触发 □ 软件自动触发  □ 其他(请填写)： | | | | | | | |
| 交易策略类型及简要说明（不少于150字） |  | | | | | | | |
| **交易软件信息** | | | | | | | | |
| 软件名称 | 所属厂商/软件提供者 | | 使用者是否可自行修改程序代码 | | | 行情信息来源 | 基本功能描述 | |
| （软件1） |  | | □ 是 □ 否 | | |  |  | |
| （软件2） |  | | □ 是 □ 否 | | |  |  | |
| （软件3） |  | | □ 是 □ 否 | | |  |  | |
| **风控措施信息** | | | | | | | | |
| 系统每秒报单量的设定阈值 | | \_\_\_手/每秒 | | 系统每秒撤单量的设定阈值 | | | | \_\_\_手/每秒 |
| 系统每秒报单笔数的设定阈值 | | \_\_\_笔/每秒 | | 系统每秒撤单笔数的设定阈值 | | | | \_\_\_笔/每秒 |
| 是否具备系统应急处置流程 | | □ 是 □ 否 | | 是否具备错单处置机制 | | | | □ 是 □ 否 |
| 是否具备极端波动应对策略 | | □ 是 □ 否 | | 是否有防止自成交的措施 | | | | □ 是 □ 否 |
| 是否有防止频繁报撤的措施 | | □ 是 □ 否 | | 是否有防止大额报撤单的措施 | | | | □ 是 □ 否 |
| 风控及其他情况说明（如有） | |  | | | | | | |
| **会员单位人员信息及意见** | | | | | | | | |
| 负责该信息报备工作的业务人员 | 姓名 | | | |  | | | |
| 职务 | | | |  | | | |
| 座机 | | | |  | | | |
| 手机 | | | |  | | | |
| 电子邮箱 | | | |  | | | |
| 会员单位意见 | * 本单位已对客户报备信息进行尽职审查并同意客户报备。 | | | | | | | |

客户签字或盖章: 填报日期：

说明：

1. 以“会员号\_客户号\_报备日期”为文件名。

2. 请于每个交易日15:00前将电子文档通过参与人平台上传。

3. 此表可以PDF或WORD格式上传，文件大小不超过10M。若有附页说明，请在一个文件中上传。