

附件：

沪深 300 股指期权交易信息报备表

| | | | |
|------------------------|---|-----------|------|
| 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 | <input type="checkbox"/> 个人客户 <input type="checkbox"/> 券商自营 <input type="checkbox"/> 公募基金 <input type="checkbox"/> 保险产品 <input type="checkbox"/> 私募基金 | | |
| | <input type="checkbox"/> 一般机构 <input type="checkbox"/> 券商集合理财 <input type="checkbox"/> 公募专户 <input type="checkbox"/> 信托产品 <input type="checkbox"/> 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 | <input type="checkbox"/> 是 <input type="checkbox"/> 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 | <input type="checkbox"/> 人工触发 <input type="checkbox"/> 软件自动触发 <input type="checkbox"/> 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) | | <input type="checkbox"/> 是 <input type="checkbox"/> 否 | | |
| (软件2) | | <input type="checkbox"/> 是 <input type="checkbox"/> 否 | | |
| (软件3) | | <input type="checkbox"/> 是 <input type="checkbox"/> 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 | <input type="checkbox"/> 是 <input type="checkbox"/> 否 | 是否具备错单处置机制 | <input type="checkbox"/> 是 <input type="checkbox"/> 否 | |
| 是否具备极端波动应对策略 | <input type="checkbox"/> 是 <input type="checkbox"/> 否 | 是否有防止自成交的措施 | <input type="checkbox"/> 是 <input type="checkbox"/> 否 | |
| 是否有防止频繁报撤的措施 | <input type="checkbox"/> 是 <input type="checkbox"/> 否 | 是否有防止大额报撤单的措施 | <input type="checkbox"/> 是 <input type="checkbox"/> 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 | <input type="checkbox"/> 本单位已对客户报备信息进行尽职审查并同意客户报备。 | | | |

填报人:

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 前将电子文档通过会员服务系统上传。
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。