

关于股指期权合约交易信息报备的通知

2022-07-18

中金所发〔2022〕40号

各会员单位：

为规范股指期权合约交易行为，维护市场交易秩序，保护市场参与者的合法权益，交易所将自2022年7月22日起进一步完善交易信息报备相关工作，现将具体事项通知如下：

一、客户报备标准

1. 在股指期权某一合约上每秒申报笔数达到10笔以上（含10笔）的客户，应当通过所在期货公司会员向交易所报备相关信息。申报笔数是指买入、卖出以及撤销委托笔数的总和。

2. 同一客户通过不同期货公司会员申报交易，其申报笔数合并计算。因即时全部成交或撤销限价指令、即时成交剩余撤销限价指令自动形成的撤单笔数计入申报笔数统计。做市商因做市交易产生的申报笔数不计入统计。

二、报备具体要求

1. 对达到报备标准的客户，交易所将通知客户所在的期货公司会员，期货公司会员应当及时告知客户。客户应当通过期货公司会员向交易所进行相关信息报备，履行信息报备义务，规范交易行为。

2. 报备内容涉及客户基本信息、软件信息、交易策略、风控措施等。交易所可以根据客户交易行为、报备信息等要求客户补充报告相关信息。报备信息有效期为6个月。

3. 期货公司会员应当在收到交易所通知后的5个交易日内，通过参与人平台填报并上传《股指期权合约交易信息报备表》，每个交易日15:00前上报视为当日报备。

4. 报备客户需向期货公司会员提供签字或盖章版的纸质件，期货公司会员留存纸质件备查。

5. 交易所对期货公司会员提交的报备材料进行核查，发现信息不全或存有疑义的，将向期货公司会员进行反馈，要求补充材料或进行相关解释。期货公司会员在收到反馈后，应当按照要求及时修改或补充材料后重新进行报备。

三、报备管理要求

1. 达到报备标准的客户，未在 5 个交易日内通过所在期货公司会员向交易所报备的，第一次出现，交易所将对客户所在期货公司会员进行电话提示；第二次出现，交易所将该客户列入重点监管名单；第三次及以上出现，交易所可以采取要求提交书面承诺、限制开仓等措施。情节严重的，按《中国金融期货交易所违规违约处理办法》的有关规定处理。

2. 对于拒绝提供信息、不按要求提供信息或提供虚假信息的客户，交易所可根据情节轻重，对其采取要求报告情况、约见谈话、要求提交书面承诺、限制开仓等措施。

3. 期货公司会员应当高度重视股指期货交易信息报备工作，切实履行报备管理职责，加强对客户股指期货交易的运行监控，并针对客户交易可能发生的异常情况，建立预防、发现与处置机制，自觉维护股指期货交易的正常秩序。

4. 对于未能履职尽责的期货公司会员，交易所可根据情节轻重，采取口头警示、书面警示、约见谈话、限制或者暂停相关业务等措施。

5. 交易所可以根据情况对本通知规定的具体标准、内容、方式、报送时间及其实施时间等进行调整。

本通知自 2022 年 7 月 22 日起实施，《关于沪深 300 股指期货交易信息报备的通知》（2019 年 12 月 18 日发布）同时废止。

特此通知。

附件：股指期权合约交易信息报备表

中国金融期货交易所

2022年7月18日