

附件：

## 股指期权合约交易信息报备表

会员名称		会员号	
<b>客户信息</b>			
客户名称		客户号	
身份证或机构组织代码等开户证件号码			
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)
<b>交易相关信息</b>			
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
		<input type="checkbox"/> 是 <input type="checkbox"/> 否		
		<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。			

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，示例 1234\_12345678\_20220101。
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. 文件大小不超过 10M。若有附页说明，请在一个文件中上传。