**附件一**

**股票期权业务程序交易报备表**

|  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- |
| 期权经营机构名称 |  | 期权经营机构编码 |  |
| 报备账户类型 | * 首次报备
* 变更报备
* 撤销报备
 | 报备账户类型 | * 个人账户
* 机构账户
 |
| **个人账户报备信息（个人账户填写）** |
| 账户名称 |  | 合约账户 |  |
| 两融账户 |  | 期货账户 |  |
| 身份证或开户有效证件 |  | 交易单元 |  |
| 联系电话 |  | 电子邮箱 |  |
| 资金规模 |  | 资金来源 | □ 个人自有资金□ 其他（请填写）  |
| **机构账户报备信息（机构账户填写）** |
| 账户名称 |  | 合约账户 |  |
| 两融账户 |  | 期货账户 |  |
| 机构组织代码 |  | 交易单元 |  |
| 联系人电话 |  | 联系人邮箱 |  |
| 账户类型 | □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 |  | 期权交易资金规模 |  |
| 资金来源 | □自有资金（一般法人）；□券商自营；□公募基金；□私募基金；□证券公司定向计划;□证券公司集合计划; □基金公司特定客户资管计划; □商业银行理财产品;□保险公司资管计划;□保险产品;□信托产品;□期货公司资管计划;□QFII;□RQFII;□企业年金;□其他  |
| 资金是否使用杠杆 |  | 资金杠杆倍数 |  |
| 企业性质 | * 国有企业
* 国有控股
* 合资企业
* 私营企业
* 其他 (请填写)
 | 实际控制人 | * 国有
* 私营
* 外资
* 其他(请填写)

  |
| **机构账户主要交易员信息（机构账户填写）** |
| 序号 | 名字 | 工作城市 | 工作年限 | 联系方式 | 是否有境外交易经历（是/否） | 期权交易经历简介 |
| 1 |  |  |  |  |  |  |
| 2 |  |  |  |  |  |  |
| 3 |  |  |  |  |  |  |
| 4 |  |  |  |  |  |  |
| **程序交易相关信息** |
| 交易系统服务器所在城市 |  | 下单系统服务器所在城市 |  |
| 订单申报峰值 |  笔/每秒 笔/每天 |
| 交易模式 | 日内高频交易:□ 人工触发 □ 软件自动触发日内非高频交易:□ 人工触发 □ 软件自动触发□ 其他(请填写)：  |
| 交易品种 | □ 期权市场 □ 现货市场 □ 期货市场  |
| 交易策略类型及简要说明 |  |

|  |
| --- |
| **程序交易软件信息** |
| 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（是/否） | 行情来源 | 基本功能描述（可附页说明） |
|  |  |  |  |  |
|  |  |  |  |  |
| 风控及其他情况说明 |  |
| 升级历史说明 |  |
| **期权经营机构人员信息及意见** |
| 管理该程序交易者的对接人员 | 姓名 |  |
| 职务 |  |
| 座机 |  |
| 手机 |  |
| 电子邮箱 |  |
| 管理该程序交易者风险控制人员 | 姓名 |  |
| 职务 |  |
| 座机 |  |
| 手机 |  |
| 电子邮箱 |  |
| 姓名 |  |
| 期权经营机构意见  | * 本期权经营机构已对客户报备信息进行尽职审查并同意客户报备。
 |
| 签字及盖章 |  |

填报人: 填报日期：

说明：

1、 本表格适用于非做市商账户填写。表格信息除明确了“个人账户填写”、“机构账户填写”外，其他所有信息必填，如不适用请填写“不适用”。

2、 期权经营机构编码一栏期货公司填写会员编号。

3、 “首次报备”适用于客户第一次报备。

4、 当投资者对首次报备的以下信息发生变更时，需要再次提交报备，报备账户类型填写“变更报备”：

1）机构账户资金来源发生变更；

2）机构账户实际控制人发生变更；

3）机构账户主要交易员信息发生变更；

4）交易系统、下单系统服务器所在城市发生变更；

5）程序交易软件信息发生重大变更；

6）其他重大信息变更。

5、 当客户对已报备的程序交易账户撤销程序交易权限时，适用于“撤销报备”。

6、 期权经营机构签字及盖章要求：衍生品经纪业务负责人或其委托授权人签字，加盖衍生品经纪业务部门印章或负责衍生品经纪业务的部门印章。

7、 按客户分文件填列信息，以“期权经营机构代码\_衍生品合约账户\_报备日期”为文件名。

8、 请于每个交易日的15:00至17:00传真至上交所，并将电子档以电子邮件发送至指定邮箱。

传真号：021-68810528-62#

电子邮箱：riskdispose01@sse.com.cn