附件1-3

上海证券交易所沪股通投资者程序化交易

报告信息填报注意事项

为确保沪股通投资者程序化交易报告信息符合相关填报规范要求并顺利上传，请重点关注以下填报注意事项：

一、程序化交易报告文件格式及命名规范

报告以增量方式进行，此前已成功上传的账户无需重复报告。每个沪股通交易日，联交所参与者将当日报告信息汇总形成《上海证券交易所沪股通投资者程序化交易信息报告表》（以下简称《信息报告表》）后，通过指定路径提交至联交所。如报告账户中包含高频交易账户的，须同步提交高频交易系统测试报告和故障应急方案。如包含高频交易账户但存在《上海证券交易所证券交易规则适用指引第2号——沪股通投资者程序化交易报告》（以下简称《报告指引》）规定的豁免额外报告情形，须提交相关证明文件的，应同步提交。

上述文件均分别压缩为zip格式文件（压缩包）提交。具体提交路径及规范性要求由联交所另行规定。上述文件的格式、命名规范及压缩包命名规范详见表1。

**表1 各类报告文件的格式及命名规范要求**

| **序号** | **文件类型** | **文件格式** | **文件命名规范** | **zip文件（压缩包）命名规范** |
| --- | --- | --- | --- | --- |
| 1 | 《信息报告表》 | xlsx | SH\_PGTDRPT\_\*\*\*\*\*\_YYYYMMDD.xlsx该excel文件中仅能包含一个工作簿（sheet） | SH\_PGTDRPT\_\*\*\*\*\*\_YYYYMMDD.zip该zip文件中仅能包含1个excel文件 |
| 2 | 高频交易系统测试报告及故障应急方案（如适用） | pdf | （1）测试报告：SH\_HFTRPTST\_\*\*\*\*\*\_XXXXXXXXXX\_YYYYMMDD.pdf（2）应急方案：SH\_HFTRPCTG\_\*\*\*\*\*\_XXXXXXXXXX\_YYYYMMDD.pdf | SH\_HFTRP\_\*\*\*\*\*\_YYYYMMDD.zip该zip文件中可包含多个账户的高频交易额外报告文件 |
| 3 | 特定主体达到高频交易标准，申请豁免额外报告的证明文件（如适用） | pdf | （1）对于仅发行公众基金的基金管理人，应当提交豁免申请表和香港证监会受规管活动第9类提供资产管理的牌照，命名格式分别为：SH\_HFTEXAPP\_\*\*\*\*\*\_XXXXXXXXXX\_YYYYMMDD.pdf、SH\_HFTEXLCC\_\*\*\*\*\*\_XXXXXXXXXX\_YYYYMMDD.pdf（2）对于从事资产管理业务且符合相关要求的联交所参与者，应当提交豁免申请表和香港证监会受规管活动第9类提供资产管理的牌照，命名格式分别为：SH\_HFTEXAPP\_\*\*\*\*\*\_XXXXXXXXXX\_YYYYMMDD.pdf、SH\_HFTEXLCP\_\*\*\*\*\*\_XXXXXXXXXX\_YYYYMMDD.pdf | SH\_HFTEX\_\*\*\*\*\*\_YYYYMMDD.zip该zip文件中可包含多个账户的申请豁免证明文件 |

**说明：**\*\*\*\*\*为联交所分配的5位经纪商代码，XXXXXXXXXX为联交所参与者向投资者编派的券商客户编码，YYYY表示年份，MM表示月份，DD表示日期，需与向联交所提交报告当日日期相符。文件名称、格式等不符合上述要求的均会导致上传失败。

二、程序化交易报告语言要求

对于描述类字段（其他资金来源描述、其他杠杆资金来源描述、主策略概述、辅策略概述、指令执行方式概述等）以及高频交易系统测试报告及故障应急方案，填报语言原则上为简体中文。对于个别难以确定统一中文表述的字段，例如联交所参与者名称、账户名称、程序化交易软件名称等，可以填写英文。

三、程序化交易信息报告表填写规范要求

请从上交所官网（www.sse.com.cn）《报告指引》附件或者联交所官网指定链接下载填报模板《信息报告表》填写，切勿对模板中除示例以外的其他内容、格式做任何调整。请严格按照表2填写规范要求填写各个字段。不符合相关要求的，会导致该zip文件上传失败，需根据返回的错误提示修改相关内容后重新上传。

**表2 《信息报告表》各字段填写规范要求**

| **序号** | **字段名** | **长度** | **填写规范要求****（所有字段均用文本格式填写）** |
| --- | --- | --- | --- |
| 1 | 联交所参与者名称 | C100 | **必填项**。填写联交所参与者全称。若上传报告表的联交所参与者与执行交易的联交所参与者不同，应当填写执行交易联交所参与者的公司全称。 |
| 2 | 经纪商代码 | C5 | **必填项**。必须是5位数字。需注意以文本格式填写该字段，确保该字段的“0”能够成功保留。若上传报告表的联交所参与者与执行交易的联交所参与者不同，应当填写执行交易联交所参与者的经纪商代码。 |
| 3 | 账户名称 | C200 | **必填项**。填写账户名称的全称。 |
| 4 | 证件号码 | C80 | **若报告类型为“首次”或“变更”，则必填**。填写投资者登记券商客户编码时的证件号码，例如机构投资者填写LEI码。 |
| 5 | 产品编码（选填） | C50 | 选填。 |
| 6 | 券商客户编码 | C10 | **必填项**。（1）填写联交所参与者向沪股通程序化交易投资者编派的唯一券商客户编码。位数最小3位，最大10位。（2）同一日上传的文件中，同一券商客户编码只能报一条记录，不能重复出现，否则会导致上传失败。（3）经纪商代码+券商客户编码会校验是否存在并生效。若无效，则上传失败。 |
| 7 | 产品管理机构名称 | C200 | 非必填项。如为产品账户，填写该产品管理机构全称。 |
| 8 | 报告类型 | C6 | **必填项**，填写以下任一项：* 首次
* 变更
* 停止使用

（1）首次报告的，填写“首次”，最近一次的报告类型必须是“停止使用”或未报告过。（2）报告类型为“变更”的，最近一次的报告类型必须是“首次”或“变更”。在发生变更的栏目填写变更后的信息，未变更的栏目填写原信息。（3）报告类型为“停止使用”的，最近一次的报告类型必须是“首次”或“变更”。仅需填写联交所参与者名称、经纪商代码、账户名称、券商客户编码、报告日期5个字段，其他字段均为非必填项。 |
| 9 | 报告日期 | C8 | **必填项**，YYYYMMDD，会校验日期格式。填写的报告日期不得晚于提交报告表的日期。 |
| 10 | 是否选取一家联交所参与者集中填报资金信息 | C1 | **若报告类型为“首次”或“变更”，则必填**。填写以下任一项：* 是
* 否

       若该字段填写“是”，机构投资者选取一家联交所参与者并按机构维度填写账户资金信息相关字段（包括账户资金规模、账户资金来源、其他资金来源描述、资金来源占比、杠杆资金规模、杠杆资金来源、其他杠杆资金来源描述、杠杆率）。其以同一证件号码在其他联交所参与者开立的账户，不再重复填写上述信息，并在相应字段填写“已在其他联交所参与者报告”。 |
| 11 | 账户资金规模（人民币，万元） | C30 | **若报告类型为“首次”或“变更”，则必填**。最多两位小数，兼容整数。请留意填写单位为“人民币，万元”。如选择一家联交所参与者填报资金信息，向其他参与者报告时，此字段填写“已在其他联交所参与者报告”。 |
| 12 | 账户资金来源 | C30 | **若报告类型为“首次”或“变更”，则必填**。填写以下任一项或多项，若多项中间用“;”（英文分号）分隔，例如“自有资金;杠杆资金”：* 自有资金
* 募集资金
* 杠杆资金
* 其他

请严格按照上述四类资金来源类别填写，否则无法提交。如选择一家联交所参与者填报资金信息，向其他参与者报告时，此字段填写“已在其他联交所参与者报告”。 |
| 13 | 其他资金来源描述 | C200 | **若“账户资金来源”包含“其他”，则必填**，否则可不填。如选择一家联交所参与者填报资金信息，向其他参与者报告时，此字段填写“已在其他联交所参与者报告”。 |
| 14 | 资金来源占比 | C50 | **若报告类型为“首次”或“变更”，则必填**。（1）如为单一资金来源，资金来源占比填写“具体资金来源100%”。如存在多个资金来源，填写不同资金来源的占比，用“;”（英文分号）分隔。（2）资金来源内容须与“账户资金来源”字段一致，占比之和须等于100%。例如，账户资金来源填写了“自有资金;募集资金”，则资金来源占比填写“自有资金80%;募集资金20%”。（3）如选择一家联交所参与者填报资金信息，向其他参与者报告时，此字段填写“已在其他联交所参与者报告”。 |
| 15 | 杠杆资金规模(人民币，万元） | C30 | **若报告类型为“首次”或“变更”，则必填**。（1）最多两位小数，兼容整数。请留意填写单位为“人民币，万元”。（2）若“账户资金来源”不包含“杠杆资金”，即无杠杆资金，则填写为“0”。（3）若“账户资金来源”包含“杠杆资金”，本字段应当填写大于0的数值。（4）填写的杠杆资金规模不应超过账户资金规模。（5）如选择一家联交所参与者填报资金信息，向其他参与者报告时，此字段填写“已在其他联交所参与者报告”。 |
| 16 | 杠杆资金来源 | C30 | **若“账户资金来源”包含“杠杆资金”，则必填**，否则可不填。可填写以下任一项或多项，若多项中间用“;”（英文分号）分隔，例如“融资融券;场外衍生品”：* 融资融券
* 场外衍生品
* 其他

如选择一家联交所参与者填报资金信息，向其他参与者报告时，此字段填写“已在其他联交所参与者报告”。 |
| 17 | 其他杠杆资金来源描述 | C200 | **若“杠杆资金来源”包含“其他”，则必填**，否则可不填。如选择一家联交所参与者填报资金信息，向其他参与者报告时，此字段填写“已在其他联交所参与者报告”。 |
| 18 | 杠杆率（%） | C20 | **若报告类型为“首次”或“变更”，则必填**。（1）杠杆率计算方式为：总资产规模/净资产规模。（2）直接填写数字，最多保留两位小数，无需填写百分号。即若杠杆率为200%，则填写“200”。（3）若“账户资金来源”不包含“杠杆资金”，即无杠杆资金，则填写“100”。（4）若“账户资金来源”包含“杠杆资金”，应当填写大于100的数值。（5）填写小于100的数值会导致上传失败。（6）如选择一家联交所参与者填报资金信息，向其他参与者报告时，此字段填写“已在其他联交所参与者报告”。 |
| 19 | 交易品种 | C20 | **若报告类型为“首次”或“变更”，则必填**。填写以下任一项或多项，若多项中间用“;”（英文分号）分隔：* 股票
* 基金
 |
| 20 | 是否量化交易 | C1 | **若报告类型为“首次”或“变更”，则必填**。填写以下任一项：* 是
* 否
 |
| 21 | 主策略类型 | C20 | **若“是否量化交易”填写“是”，则必填**，否则可不填，只能填写以下一项:* 指数增强策略
* 市场中性策略
* 多空灵活策略
* 量化多头策略
* 管理期货策略CTA
* 参与新股发行策略
* 量化套利策略
* 日内回转策略
* 其他
 |
| 22 | 其他主策略类型 | C200 | **若“主策略类型”填写“其他”，则必填**，否则可不填。 |
| 23 | 主策略概述 | C500 | **若填写了“主策略类型”，则必填**，否则可不填。 |
| 24 | 辅策略类型 | C50 | 非必填项，可填写以下任一项或最多两项，若两项中间用“;”（英文分号）分隔：* 指数增强策略
* 市场中性策略
* 多空灵活策略
* 量化多头策略
* 管理期货策略CTA
* 参与新股发行策略
* 量化套利策略
* 日内回转策略
* 其他
 |
| 25 | 其他辅策略类型 | C200 | **若“辅策略类型”包含“其他”，则必填**，否则可不填。 |
| 26 | 辅策略概述 | C500 | **若填写了“辅策略类型”，则必填**，否则可不填。 |
| 27 | 期货市场账户名称（选填） | C200 | 选填。 |
| 28 | 期货市场账户代码（选填） | C300 | 选填。 |
| 29 | 交易指令执行方式 | C50 | **若报告类型为“首次”或“变更”，则必填**。填写以下任一项或多项，若多项中间用“;”（英文分号）分隔：* TWAP
* VWAP
* POV
* 其他
 |
| 30 | 其他方式描述 | C500 | **若“交易指令执行方式”包含“其他”，则必填**，否则可不填。 |
| 31 | 指令执行方式概述 | C500 | **若报告类型为“首次”或“变更”，则必填**。 |
| 32 | 账户最高申报速率 | C20 | **若报告类型为“首次”或“变更”，则必填**。填写以下任一项枚举值：* 500笔及以上
* 300笔至499笔
* 100笔至299笔
* 100笔以下

严格按上述选项填写，否则无法提交。例如账户最高申报速率为400笔/秒，则填写“300笔至499笔”。 |
| 33 | 账户单日最高申报笔数 | C20 | **若报告类型为“首次”或“变更”，则必填**。填写以下任一项枚举值：* 25000笔及以上
* 20000笔至24999笔
* 15000笔至19999笔
* 10000笔至14999笔
* 10000笔以下

严格按上述选项填写，否则无法提交。例如账户单日最高申报笔数为30000笔/天，则填写“25000笔及以上”。 |
| 34 | 程序化交易软件名称及版本号 | C200 | **若报告类型为“首次”或“变更”，则必填**。涉及多个软件，用“;”（英文分号）分隔。 |
| 35 | 程序化交易软件开发主体 | C200 | **若报告类型为“首次”或“变更”，则必填**。涉及多个主体，用“;”（英文分号）分隔。 |
| 36 | 高频交易系统服务器所在地 | C100 | （1）填报的“账户最高申报速率”区间在每秒300笔以上，或者填报的“账户单日最高申报笔数”区间在20000笔以上，且不符合有关豁免要求的，须填写高频交易系统服务器所在地的具体地址。（2）符合《报告指引》第七条规定豁免情形的，在本字段填写“已申请豁免”。（3）账户最高申报速率或单日最高申报笔数未达到上述标准的，可不填。 |
| 37 | 联交所参与者联络人（选填） | C80 | 选填。 |
| 38 | 联交所参与者联络人联系方式（选填） | C80 | 选填。 |
| 39 | 投资者相关业务负责人（选填） | C80 | 选填。 |
| 40 | 投资者相关业务负责人联系方式（选填） | C80 | 选填。 |
| 41 | 是否上传测试报告及应急方案 | C5 | **若报告类型为“首次”或“变更”，则必填**。填写以下任一项：* 是
* 否
* 已申请豁免

（1）填报的“账户最高申报速率”区间在每秒300笔以上，或者填报的“账户单日最高申报笔数”区间在20000笔以上，且不符合有关豁免要求的，填写“是”并同步上传测试报告及应急方案。（2）符合《报告指引》第七条规定豁免情形的，在本字段填写“已申请豁免”。（3）不适用的填写“否”。 |
| 42 | 合格境外投资者编码 | C50 | **具有合格境外投资者资格的投资者拟适用拆单条款豁免高频额外报告的，则必填**，否则可不填。 |

对于报告类型、是否选取一家联交所参与者集中填报资金信息、账户资金来源、杠杆资金来源、交易品种、是否量化交易、主策略类型、辅策略类型、交易指令执行方式、账户最高申报速率、账户单日最高申报笔数、是否上传测试报告及应急方案等含枚举值的填报字段，需注意枚举值前后及中间不得有空格或换行符，不得出现枚举值重复的情形。