关于上海期货交易所完善部分程序化交易客户报备信息要求的通知

来源：上海期货交易所 时间：2021-07-23

上期办发〔2021〕62号

各会员单位：

为进一步加强程序化交易报备工作，根据《上海期货交易所交易规则》第二十九条的规定，自2021年7月23日起，上海期货交易所（以下简称上期所）将进一步完善部分程序化交易客户的交易信息报备要求。

一、客户报备标准

1．上期所将根据客户的申报、撤单、成交等交易数据，筛选需要完善报备信息的程序化交易客户名单。

2．对于同一客户在不同会员处开有多个交易编码的，上期所对其申报、撤单、成交等指标合并计算。

二、报备要求

1．对达到报备标准的客户，上期所将通知客户所在的会员，会员应当及时告知客户。客户应当通过会员向上期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。上期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。

3．会员应当在收到上期所通知后的10个交易日内，通过会员服务系统填报并上传《程序化交易客户信息报备表》，每个交易日15:00前上报视为当日报备。报备客户需向会员提供签字或盖章版的纸质件，会员留存纸质件备查。

4．上期所对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，将向会员进行反馈，要求客户补充材料或进行相关解释。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。

5．《关于做好程序化交易报备工作的通知》（上期交交易字〔2010〕250号）涉及的程序化交易报备工作仍按规定执行。

请各会员单位高度重视，切实履行报备职责。对于未能履职尽责的会员及拒绝提供信息、不按要求提供信息或提供虚假信息的程序化交易客户，上期所可以对其采取自律监管措施。

特此通知。

上海期货交易所办公室

2021年7月23日