

关于股票期权程序化交易管理的通知

时间：2019-12-07

字体：大 中 小

深证上〔2019〕808号

各市场参与人：

为加强对通过计算机程序实现自动下单或者快速下单的股票期权交易（以下简称程序化交易）的管理，防范程序化交易可能引发的风险，维护股票期权交易秩序，根据《深圳证券交易所股票期权试点交易规则》，深圳证券交易所（以下简称本所）现就股票期权程序化交易的有关事项通知如下：

一、期权经营机构应当建立程序化交易接入管理制度，明确客户进行程序化交易的相关要求和管理机制，对客户进行程序化交易实行严格的接入和认证管理。

二、期权经营机构应当根据程序化交易管理制度，对客户使用自有、第三方提供或者期权经营机构提供的交易软件或者接口进行程序化交易的申请，进行审核、测试及认证，对符合条件的客户开通程序化交易权限，并与客户签署程序化交易业务协议，明确各自的权利、义务。

客户未提出程序化交易申请或者未通过认证的，期权经营机构不得为其开通程序化交易权限。

三、客户使用自有、第三方或者期权经营机构提供的交易软件或者接口进行程序化交易的，应当事先向期权经营机构提出申请，经期权经营机构开通程序化交易权限后，方可进行程序化交易。

客户未开通程序化交易权限即自行开展程序化交易的，期权经营机构发现后应当及时予以制止，并向本所报告。

四、期权经营机构应当为已开通程序化交易权限的客户设置专门的接入柜台系统的委托通道，并和未开通程序化交易权限的客户接入柜台系统的委托通道实行隔离管理。

五、期权经营机构应当严格落实程序化交易的报备要求，出现以下情形之一的，期权经营机构应当提前5个交易日向本所进行报备，填报《股票期权业务程序化交易报备表》，本所根据情况可要求补充投资者尽职调查报告、系统测试报告、业务部门审批意见、合规部门或风控部门审批意见、业务协议等材料：

（一）期权经营机构自行进行程序交易的；

（二）客户申请使用自有、第三方或者期权经营机构提供的交易软件或者接口进行程序化交易，期权经营机构经审核、认证后拟为其开通程序交易权限的；

（三）本所规定的其他情形。

六、已报备的程序化交易账户发生以下信息变更时，期权经营机构应当提前2个交易日向本所进行信息变更报备：

- （一）账户资金来源发生变更；
- （二）账户实际控制人发生变更；
- （三）账户主要交易员信息发生变更；
- （四）交易系统或下单系统服务器所在城市发生变更；
- （五）程序交易软件信息发生重大变更；
- （六）其他重大信息变更。

七、期权经营机构报备的程序化交易应当基于真实交易需求，材料应当真实、准确、完整。

八、本所以对期权经营机构提交的报备材料进行核查，发现信息不全或存有疑义的，将在收到报备材料的5个交易日内向期权经营机构进行反馈，要求补充材料或进行相关解释。期权经营机构在5个交易日内未收到本所反馈的，报备账户可于报送之日起5个交易日后进行股票期权程序化交易。

九、期权经营机构应当加强对程序化交易的运行监控，并针对客户程序化交易可能发生的异常情况，建立预防、发现与处置机制，自觉维护期权交易的正常秩序。

客户进行程序化交易出现或者可能出现异常的，期权经营机构应当按照与客户的约定，及时采取应急处置措施，包括但不限于限制客户交易权限、为客户提供紧急撤单服务等。

十、投资者可以通过期权经营机构向本所申请撤销程序化交易账户报备，撤销报备后的账户在再次报备前不得进行程序化交易。

十一、期权经营机构、客户违反本通知规定的，本所可以根据相关业务规则的规定，对其采取相应监管措施或者纪律处分。

本通知自发布之日起施行。

特此通知

深圳证券交易所

2019年12月7日