

## 附件 2

# 《北京证券交易所程序化交易投资者 信息报告表》填报说明

为做好北京证券交易所股票程序化交易投资者信息报告工作，现就《北京证券交易所程序化交易投资者信息报告表》（以下简称《信息报告表》）填报要求说明如下：

### 1. 应当履行报告义务的投资者范围

投资者符合以下情形之一的，应当履行报告义务：

（1）下单自动化程度高。证券代码、买卖方向、委托数量、委托价格等指令的核心要素以及指令的下达时间均由计算机自动决定的程序化交易投资者。

（2）申报速率快。1 天出现 10 次以上 1 秒钟内 10 笔以上申报（含撤单申报）的程序化交易投资者。

（3）交易股票只数多、换手率高。最近 30 个交易日日均交易北京证券交易所股票不少于 50 只，且最近 30 个交易日年化换手率<sup>1</sup>在 30 倍以上的程序化交易投资者。

（4）使用自主研发或其他定制软件的程序化交易投资者。

（5）本所认定的需要报告的其他情形。

---

<sup>1</sup> 年化换手率=该账户（最近 30 个交易日北京证券交易所日均交易金额）/（最近 30 个交易日北京证券交易所日均持仓金额）×当年交易日天数

使用会员为客户提供的带有一定自动化功能的客户端软件进行交易，且不符合上述条件的投资者，无需进行报告。

## **2. 存量投资者报告要求**

《通知》施行前一年内开展过股票程序化交易且此后仍将持续开展的投资人，应当向本所报告。存量投资者应当在《通知》施行后 60 个交易日内完成报告。

### **3. “会员/其他机构名称” 填报要求**

由发送《信息报告表》的会员或使用交易单元的其他机构填写公司全称。

### **4. “会员/其他机构编码” 填报要求**

由发送《信息报告表》的会员或使用交易单元的其他机构填写交易所分配的编码。

### **5. “账户名称” 填报要求**

填写账户名称的全称。

### **6. “证件号码” 填报要求**

填写投资者开立证券账户时在中国证券登记结算有限责任公司登记的证件号码，填写格式需与开户时登记的证件号码格式保持一致。

### **7. “备案产品编码” 填报要求**

如报告账户为中国证券投资基金业协会备案的产品账户，填写该产品账户备案的产品编码。

## 8. “证券账户代码”填报要求

填写投资者名下开展程序化交易的证券账户代码。一个投资者名下有多个账户参与交易，分行填写，一个账户填一行。

## 9. “产品管理机构名称”填报要求

如为产品账户，填写该产品管理人全称。例如，私募产品账户填写私募产品管理机构全称。

## 10. “产品管理机构类别”填报要求

在以下选项中选择：（1）证券公司；（2）公募基金管理机构；（3）公募基金管理机构子公司；（4）已在中国证券投资基金业协会备案的私募基金管理人；（5）QFII/RQFII；（6）其他。

## 11. “报告类型”填报要求

（1）首次报告的，填写“首次”。报告信息发生重大变更情形的，填写“变更”。属于重大变更情形中“账户停止进行程序化交易”的，填写“停止使用”。

（2）报告类型为“变更”的，在发生变更的栏目填写变更后的信息，未发生变更的栏目填写原信息。

（3）报告类型为“停止使用”的，填写账户基本信息。其中“停止使用”是指该账户“停止使用”报告后不再进行程序化交易。如需重新进行的，应当再次报告，报告方式按照首次报告进行。

## 12. 变更报告填报要求

客户报告信息发生重大变更的，应当在变更发生后下一个自然月的前 5 个交易日内向会员进行变更报告，会员应当在收到变更报告之日起 5 个交易日内向本所报告。会员及使用交易单元的其他机构报告信息发生重大变更的，应当在变更发生后下一个自然月的前 5 个交易日内向本所进行变更报告。

已报告信息存在下列情形的，属于重大变更，应当报告：

（1）账户资金规模增长 5 倍以上，且增长金额超过 1000 万元；（2）杠杆资金来源发生变更；（3）杠杆资金规模变动超过 1 倍以上，且变动金额超过 500 万元；（4）会员单位联络人、投资者负责人发生变更；（5）账户最高申报速率或者账户单日最高申报笔数发生变更；（6）主策略类型变更；（7）程序化交易软件信息发生变更；（8）账户停止进行程序化交易。

基金管理公司及其子公司、从事资产管理业务的会员、合格境外投资者以减少大额订单对市场冲击或者保障不同投资组合交易公平性为目的，在交易环节按照设定的拆单算法自动执行交易指令的，其报告的账户资金规模、杠杆资金来源、杠杆资金规模发生重大变更时应当在变更发生后下一季度的前 5 个交易日内进行变更报告。

### 13. “报告日期”填报要求

会员客户的报告日期填写会员客户向会员报告的日期，会员及使用交易单元的其他机构的报告日期填写向本所报告的日期。

#### 14. “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” 填报要求

资金规模填写截至报告日期账户中用于股票市场的资产总额，包括自有资金和杠杆资金，以万元为单位。对于产品账户，资金规模、来源、占比均按产品维度进行填报。

资金来源从下列选项中选择填写，可以选择多项：（1）自有资金；（2）募集资金；（3）杠杆资金；（4）其他。产品管理机构跟投的资金视为募集资金。

若资金来源包含“其他”，需要在“其他资金来源描述”字段填写资金的具体来源。

如为单一资金来源，资金来源占比填写“具体资金来源100%”，例如“自有资金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，例如“自有资金30%;杠杆资金70%”。

#### 15. “杠杆资金规模” 填报要求

填写截至报告日期账户中可能用于股票市场的杠杆资金规模，以万元为单位。对于产品账户，杠杆资金规模按产品维度进行填报。杠杆资金包括通过融资融券、与证券公司签订场外衍生品协议（例如收益互换）等形式获取的实质性融资。

#### 16. “杠杆资金来源” “其他杠杆资金来源描述” 填报要求

在以下选项中选择杠杆资金来源，可以选择多项：（1）融

资融券；（2）场外衍生品；（3）其他。对于产品账户，杠杆资金来源按产品维度进行填报。

若杠杆资金来源包含“其他”，需要在“其他杠杆资金来源描述”字段填写杠杆资金的具体来源，如个人借贷等。

#### **17. “杠杆率”填报要求**

如账户资金中包含通过券商融资、场外衍生品等方式获取的杠杆资金，填写杠杆率（截至报告日期账户中总资产规模/净资产规模）。对于产品账户，杠杆率按产品维度进行填报。

#### **18. “交易品种”填报要求**

投资者根据自身交易的证券品种，填写“股票”等品种。

#### **19. “是否量化交易”填报要求**

根据《通知》第二条规定属于量化交易的，填是。

属于量化交易的，填写主策略、辅策略类型及策略概述；不属于量化交易的，无需填写主、辅策略，直接填写交易指令执行方式及其概述。

#### **20. “主策略类型”“其他主策略类型”“主策略概述”“辅策略类型”“其他辅策略类型”“辅策略概述”填报要求**

量化交易投资者应当填写策略类型，若非量化交易无需填写。

“主策略类型”填写该账户主要使用的交易策略，为必选项，且只能从以下选项中选择1项；“辅策略类型”非必选项，仅当该账户在主策略外同时使用其他策略开展交易时填写，在以下选项

中选择辅策略类型，辅策略类型最多选择 2 个，不同辅策略类型请用“;”（英文分号）分隔：

（1）指数增强策略，指构建与对标指数具有相似特征持仓结构，通过主动管理获取相对于指数的超额收益的策略。该策略基本不开展对冲交易。

（2）市场中性策略，指同时构建多头和空头头寸以对冲市场风险的策略。该策略会利用股指期货、股指期权等对冲市场风险。

（3）多空灵活策略，指根据市场情况灵活调整多头和空头比例的策略。该策略主要根据管理人的自主判断随时调整对冲方式和对冲头寸，常用对冲方式包括股指期货、股指期权、融券卖空、场外衍生品等。

（4）量化多头策略，指通过上市公司财务数据、宏观经济等基本面指标，或者股价波动、成交量、换手率等技术指标，灵活选股并进行投资决策的策略。

（5）管理期货策略（CTA），指在期货市场使用，依据模型的买卖信号进行投资决策的策略。

（6）参与新股发行策略，指利用持有股票，参与新股首次公开发行的投资策略。

（7）量化套利策略，指利用一个或多个市场存在的价格差异，或市场价格与理论价格存在差异获利的策略。

（8）日内回转策略，指在同一个交易日内，对同一标的进

行反向交易，获取日内波动价差的策略。

(9) 其他策略，填写“其他”。

若“主策略类型”或“辅策略类型”包含“其他”，需要在“其他主策略类型”或“其他辅策略类型”字段填写具体的策略名称。

若“主策略类型”或“辅策略类型”已填写，需要在“主策略概述”或“辅策略概述”字段填写所采用策略的主要内容。

#### **21. “期货市场账户名称”填报要求**

填写在期货（含期权）市场进行对冲的账户名称全称，涉及多个账户的，账户名称之间用“;”（英文分号）分隔。

#### **22. “期货市场账户代码”填报要求**

填写在期货（含期权）市场进行对冲的账户代码，涉及多个账户的，账户代码之间用“;”（英文分号）分隔。

#### **23. “交易指令执行方式”“其他方式描述”“指令执行方式概述”填报要求**

如账户通过算法交易等方式执行交易指令，在以下选项中选择交易指令的具体执行方式，可以选择多项：

(1) 时间加权平均价格算法（TWAP）。

(2) 成交量加权平均价格算法（VWAP）。

(3) 比例成交算法（POV）。

(4) 其他方式。填写“其他”。



若“交易指令执行方式”包含“其他”，需要在“其他方式描述”字段填写具体的执行类策略名称。

若“交易指令执行方式”已填写，需要在“指令执行方式概述”字段填写所采用执行类策略的主要内容。

#### 24. “账户最高申报速率”填报要求

根据策略类型和系统情况综合预判可能达到的最高申报速率所在区间，在以下区间选择 1 个：

- (1) 每秒申报笔数 500 笔以上；
- (2) 每秒申报笔数 300 笔至 500 笔（不含）；
- (3) 每秒申报笔数 100 笔至 300 笔（不含）；
- (4) 每秒申报笔数小于 100 笔。

如选择(1)或(2)，填写“程序化交易系统服务器所在地”，并通过《通知》指定的邮箱发送程序化交易系统测试报告和程序化交易系统发生故障时的应急方案，命名规则分别为：

“报告日期+投资者名称+账户代码+系统测试报告”，例如：  
20231009xx 投资管理合伙企业（有限合伙）089xxxxxxxx 系统测试报告；

“报告日期+投资者名称+账户代码+故障应急方案”，例如：  
20231009xx 投资管理合伙企业（有限合伙）089xxxxxxxx 故障应急方案。

系统信息发生变更时，需对上述信息进行变更报告，重新填

写程序化交易系统服务器所在地并发送新的测试报告以及故障应急方案。

## 25. “账户单日最高申报笔数”填报要求

根据策略类型和系统情况综合预判可能达到的单日最高申报笔数所在区间，在以下区间选择 1 个：

- (1) 单日申报笔数 25000 笔以上；
- (2) 单日申报笔数 20000 笔至 25000 笔（不含）；
- (3) 单日申报笔数 15000 笔至 20000 笔（不含）；
- (4) 单日申报笔数 10000 笔至 15000 笔（不含）；
- (5) 单日申报笔数小于 10000 笔。

如选择(1)或(2)，填写“程序化交易系统服务器所在地”，并通过《通知》指定的邮箱发送程序化交易系统测试报告和程序化交易系统发生故障时的应急方案，命名规则分别为：

“报告日期+投资者名称+账户代码+系统测试报告”，例如：  
20231101xx 投资管理合伙企业（有限合伙）089xxxxxxx 系统测试报告；

“报告日期+投资者名称+账户代码+故障应急方案”，例如：  
20231101xx 投资管理合伙企业（有限合伙）089xxxxxxx 故障应急方案。

系统信息发生变更时，需对上述信息进行变更报告，重新填写程序化交易系统服务器所在地并发送新的测试报告以及故障

应急方案。

#### **26. “程序化交易软件名称及版本号” 填报要求**

填写程序化交易软件全称，涉及多个软件的，参照《信息报告表》示例，不同软件用“;”（英文分号）分隔。

#### **27. “程序化交易软件开发主体” 填报要求**

填写程序化交易软件开发主体全称，涉及多个主体的，参照《信息报告表》示例，不同主体用“;”（英文分号）分隔。

#### **28. “程序化交易系统服务器所在地” 填报要求**

符合《通知》第七条规定情形的投资者，填写使用的程序化交易系统服务器所在具体地址。

#### **29. “会员单位联络人” 填报要求**

填写会员或者使用交易单元的其他机构中填写、发送、维护本信息报告表的负责人及其联系方式。

#### **30. “投资者相关业务负责人” 填报要求**

(1) 会员客户。如为个人客户，填写本人及其联系方式；如为机构客户，包括私募基金、信托产品、QFII、RQFII、企业年金、社保基金等，填写机构程序化交易相关业务负责人及其联系方式。

(2) 从事自营、做市交易或者资产管理等业务的会员。包括券商自营、券商集合理财等，填写会员相关业务负责人及其联系方式。

(3) 使用交易单元的其他机构。包括公募基金、公募专户、社保基金、保险产品等，填写机构程序化交易相关业务负责人及其联系方式。

### 31. “是否发送测试报告及应急方案”

根据《通知》第七条要求发送了程序化交易系统测试报告以及程序化交易系统发生故障时的应急方案的，填“是”；不适用的留空。

### 32. 其他

(1) 请勿修改表格格式，按照“一个账户一行”的规则填写，请勿合并单元格。

(2) 填写时请将示例删除，并认真阅读报告表中每个字段的填写说明，按规范要求填写。

(3) 本填报说明“以上”包含本数，“小于”不含本数。

(4) 如有疑问，请联系 010-63889844（刘老师）。