

# 信息报告表填报说明

为做好可转债程序化交易投资者报告工作，现就《上海证券交易所可转债程序化交易投资者信息报告表》填报要求说明如下。

## 一、可转债程序化交易应履行报告义务的投资者范围

投资者符合以下条件之一的，应当履行报告义务：

（一）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。

（二）指令下达速率快。1 天出现 10 次以上 1 秒钟内 10 笔以上申报的可转债程序化交易投资者。

（三）使用自主研发或其他定制软件的程序化交易投资者。

（四）交易所认定的其他需要报告的情形。

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的，且不符合上述条件的投资者，无须进行报告。

## 二、“会员/其他机构名称”填报要求

由上传报告表的会员或直接使用交易单元的其他机构填写公司全称。

## 三、“会员/其他机构编码”填报要求

由上传报表的会员或其他机构填写其在中国上海证券交易所

所会籍业务系统中的机构代码。

#### **四、“账户名称”填报要求**

填写账户名称的全称。

#### **五、“账户代码”填报要求**

填写投资者名下参与可转债程序化交易的沪市账户代码。如一个投资者名下有多个沪市账户参与交易，请分行填写，一个账户填一行。

#### **六、“证件号码”填报要求**

（一）个人账户填写身份证号码或其他开户有效证件信息。

（二）机构产品填写管理人统一社会信用代码。

（三）一般法人填写法人统一社会信用代码。

（四）QFII、RQFII 填写经营证券期货业务许可证编码。

#### **七、变更报告填报要求**

（一）重大变更的报告要求。客户报告信息发生重大变更的，应当在 3 个交易日内向会员进行报告，会员应在收到变更报告之日起 3 个交易日内向本所报告。会员及直接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 3 个交易日内向本所进行变更报告。

（二）重大变更的情形。已报告信息发生下列变更的，属于重大变更，应当报告。

1.账户资金来源发生变更。2.会员单位联络人、投资者负责人发生变更。3.程序化交易软件信息发生变更。4.主要

策略类型变更。5.账户停止进行程序化交易。

## 八、“报告类型”填报要求

(一) 首次报告的, 填写“首次”。报告信息发生重大变更报告的, 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”。

(二) 报告类型为“变更”的, 填写会员/其他机构名称、会员/其他机构编码、账户名称、证件号码、账户代码、报告日期并在发生变更的栏目填写变更后的信息。例如, 主要策略类型从执行类变更为做市策略的, 除填写前述固定栏目外, 在“策略类型”一栏填写“做市策略”即可。

(三) 报告类型为“停止使用”的, 填写会员/其他机构名称、账户名称、账户代码、证件号码、报告日期。其中“停止使用”是指该账户“停止使用”报告后不再进行可转债程序化交易, 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。

## 九、“资金来源”填报要求

(一) 机构账户在下列选项中选择填写。

1.自有资金(一般法人)。2.券商自营。3.公募基金。4.私募基金。5.证券公司定向计划。6.证券公司集合计划。7.基金公司特定客户资管计划。8.商业银行理财产品。9.保险公司资管计划。10.保险产品。11.信托产品。12.QFII。13.RQFII。14.企业年金。15.其它(填写具体来源)。

(二) 个人账户在下列选项中选择填写。

1.个人自有资金（指完全归个人所有的资金）。2.其它（填写具体来源，例如借贷、券商融资等杠杆资金）。

## 十、“会员单位联络人”填报要求

填写会员或者其他机构中负责填写、上传、维护本信息报告表的负责人及其联系方式。

## 十一、“投资者负责人”填报要求

（一）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，填写相关业务负责人及其联系方式。

（二）从事自营或资产管理业务的会员。包括券商自营、券商集合理财等，填写会员合规负责人及其联系方式。

（三）直接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，填写机构合规负责人及其联系方式。

## 十二、“策略类型”填报要求

主要分为执行类和策略类。其中执行类指算法交易，即策略以人工判断为主，程序化主要用于订单执行层面，包括时间加权平均价格算法（TWAP）、成交量加权平均价格算法（VWAP）、比例成交算法（POV）等算法交易；策略类指策略判断层面和订单执行层面均以程序化为主的交易，主要分为基本面分析策略（Alpha 策略）、日内回转策略、套利类策略、趋势类策略、做市类策略和其它。

填写“策略类型”时，选择执行类或策略类。如选择策

略类，需在以下选项中进一步选择填写具体策略类型（可多选），选择“其它”的需简要解释策略主要内容：

（一）基本面分析策略（Alpha 策略）。精选行业、个股、产品，寻找被市场低估的产品，以获取超越大盘收益的策略。

（二）日内回转策略。指日内回转交易，获取日内波动价差的策略。

（三）套利类策略。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。

（四）趋势类策略。指利用量价等微观信息预测未来短期价格走势，并根据走势生成相应交易指令的策略。

（五）做市类策略。指为市场提供流动性，撮合买卖报价赚取盘口价差的策略。

（六）其它。简要解释策略主要内容。

### **十三、“账户最高申报速率”填报要求**

请投资者根据策略类型和系统情况综合预判，填写理论上可能达到的最高申报速率值。

### **十四、“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，请参照报告表示例，不同软件请用“；”（分号）分隔。

### **十五、“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，请参照报告表示例，不同主体请用“；”（分号）分隔。

## 十六、其他注意事项

(一) 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。

(二) 填写时请将示例删除。