

程式交易尽职调查问卷

第一部分 基本情况调查			
系统名称	若是自研產品，可寫自研		
系统来源	<input type="checkbox"/> 自主研发 <input type="checkbox"/> 购买 <input type="checkbox"/> 手动下单		
系统运维	<input type="checkbox"/> 自主运维 <input type="checkbox"/> 供应商运维		
申请程式交易接入目的	例如：實現交易自動化，方便交易策略的執行		
主要交易产品	例如：美股，港股，期權		
资金来源	例如：自由資金等		
已(拟) 运作程序交易策略数量（如适用）			
适用市场及产品	例如：美股，港股，期權		
第二部分：内部控制及胜任能力			
1	负责交易风控及程序运维支持人员数量	<input type="checkbox"/> ≤3人 <input type="checkbox"/> 4—10人 <input type="checkbox"/> ≥10人	所選的人數會影響附件2的填寫
2	系统/交易程序运作期间，是否有监控人员持续监控？		<input type="checkbox"/> 是 <input type="checkbox"/> 否
3	是否为监控人员提供足够的培训及工具监测控制系统、执行故障排除并对操作事件进行及时有效的反应？		<input type="checkbox"/> 是 <input type="checkbox"/> 否
4	是否交易运维人员拥有足够经验以胜任系统参数运维（例如：每秒发出订单量、最大持仓、每个策略的最大订单容量）？		<input type="checkbox"/> 是 <input type="checkbox"/> 否
5	是否设有政策或程序跟踪交易前及交易后风险测量进行配置、修改或调整？		<input type="checkbox"/> 是 <input type="checkbox"/> 否
6	是否设有政策及程序，以指引交易员、程序化交易监测人员及技术支持人员更正相关交易系统错误？		<input type="checkbox"/> 是 <input type="checkbox"/> 否
第三部份：交易参数设置（如为程序交易，则为单个程序交易风控参数设置）			
交易资产规模	按照實際情況填寫大概的資產規模		
最大持仓限制	如沒有相關設定，則填寫	单笔最大下单量	按實際情況填寫大概
订单流量上限	笔/秒	日内亏损限额	按實際情況填寫大概，如為人手控制則填手動控制
最高价限制功能	<input type="checkbox"/> 已启用 <input type="checkbox"/> 无	最低价限制功能	<input type="checkbox"/> 已启用 <input type="checkbox"/> 无
测试执行	通过模拟环境测试，交易程式符合设计预期		<input type="checkbox"/> 是 <input type="checkbox"/> 否
	交易程式在模拟极端市场情况下运作正常		<input type="checkbox"/> 是 <input type="checkbox"/> 否
	交易程式适应不同交易时段（例如竞价交易时段及持续交易时段）		<input type="checkbox"/> 是 <input type="checkbox"/> 否
第四部分：系统监控及应急措施 所選的某些項目需要在後續交易測試中體現			
1	是否支持异常价格、异常成交监测及预警？		<input type="checkbox"/> 是 <input type="checkbox"/> 否
2	是否设有政策/程序对系统异常/错误采取补救措施？		<input type="checkbox"/> 是 <input type="checkbox"/> 否
3	是否设置有单位时间信息传输限制？		<input type="checkbox"/> 是 <input type="checkbox"/> 否
4	是否设有政策、程序及措施，应对系统故障或错误，包括但不限于即刻系统运作？		<input type="checkbox"/> 是 <input type="checkbox"/> 否
5	是否支持交易连接监测及预警？		<input type="checkbox"/> 是 <input type="checkbox"/> 否
6	是否支持持仓限额监测措施及是否支持系统自动减仓？		<input type="checkbox"/> 是 <input type="checkbox"/> 否
7	上述交易风控参数及系统监控措施、应急措施是否已经过压力测试，使电子交易/程序交易符合相关交易所或监管部门之规则？		<input type="checkbox"/> 是 <input type="checkbox"/> 否
第五部分：客户声明			
1.本人/吾等在使用自动化程式交易交易系统时，已对所选择的程式交易系统 & 交易程式的运作有充分了解； 2.本人/吾等对自动化程式交易过程中的合规及监管事宜有充分了解，承诺及严格遵守该等合规及监管规定； 3.本人/吾等钦此承诺使用自动化交易程式将严格遵守监管机构、各交易所及尊嘉证券的相关要求，同意承担因使用程式交易系统 & 交易程式所可能遭受的一切交易结果，如因程式交易软件/交易程式故障给尊嘉证券造成的任何损失，将全额向尊嘉证券进行弥偿。			
客户签署（及/或盖章）：		签署日期：	

外部系统接驳测试表

测试日期：__年__月__日			
客户名称	ABC	客户账号	12345678
系统名称及版本号	Ayers、恒生、Link/自研	开发商	Ayers、恒生、Link/自研
接入 MAC 地址	XX.XX.XX.XX		
接入系统及功能介绍	简述系统功能，还需另附系统的逐个功能界面或程序代码，重点是风控，参见OMS操作手册		
对接测试系统名称	Ayers、恒生、Link/自研	测试客户号	
测试内容			
测试步骤	支持为每个系统使用者分配独立的识别编码，及被公司系统识别*		是 <input type="checkbox"/> 否 <input type="checkbox"/> 未测 <input type="checkbox"/> <small>如是个人客户，必须为否</small>
	交易买卖类型（正常、异常、未测）	买入指令*	是 <input type="checkbox"/> 否 <input type="checkbox"/> 未测 <input type="checkbox"/>
		卖出指令*	是 <input type="checkbox"/> 否 <input type="checkbox"/> 未测 <input type="checkbox"/>
		撤单*	是 <input type="checkbox"/> 否 <input type="checkbox"/> 未测 <input type="checkbox"/>
	交易指令类型（正常、异常、未测）	市价指令*	是 <input type="checkbox"/> 否 <input type="checkbox"/> 未测 <input type="checkbox"/>
		限价指令*	是 <input type="checkbox"/> 否 <input type="checkbox"/> 未测 <input type="checkbox"/>
		MOA	是 <input type="checkbox"/> 否 <input type="checkbox"/> 未测 <input type="checkbox"/>
		LOA	是 <input type="checkbox"/> 否 <input type="checkbox"/> 未测 <input type="checkbox"/>
	资金变化情况是否正常*		是 <input type="checkbox"/> 否 <input type="checkbox"/> 未测 <input type="checkbox"/>
	持仓变化情况是否正常*		是 <input type="checkbox"/> 否 <input type="checkbox"/> 未测 <input type="checkbox"/>
	风控情况是否正常*		是 <input type="checkbox"/> 否 <input type="checkbox"/> 未测 <input type="checkbox"/>
软件是否具备控制自成交、频繁报撤单功能*		是 <input type="checkbox"/> 否 <input type="checkbox"/> 未测 <input type="checkbox"/>	
备注：1、测试内容带*号为接入认证测试必需项，其它项目非必需全部测试通过。 2、申请程序化交易请提交具备控制自成交、频繁报撤单的功能说明，包括控制的方法，并且进行测试举证，提供测试截图、log 日志等。			
测试中遇到的问题			
测试结果（评估）			
客户签署（及/或盖章）：		签署日期：	
尊嘉证券国际内部适用			
	经办	复核	归档
签署			

在操作手册中，应当有下单逻辑即可判定风控及自成交，下单速率如果没测，可提供程序设定

系统接入测试模板

为了满足香港证监会对于外部系统接入的合规要求, 需要进行 API 的客户先完成基本功能和风控的测试, 下面是针对证监会的测试要求既《外部系统接入测试表》中的测试用例进行的情况说明。

进行测试前, 请做好下面的准备工作:

- 确保您已经获得了尊嘉证券测试环境的交易账户 (尊嘉客服会通过邮件发送给您),
- 确认您的交易环境已经切换到测试环境 tcp://uat.restapi.zvsthk.com:41005

测试环境的委托和成交说明:

- (1) 如果委托量是 1/100/1000, 状态为 已报(New)
- (2) 如果委托量是 2/200/2000, 状态为 部分成交(有 1 笔成交记录)
- (3) 如果委托量是 3/300/3000, 状态为 废单(Rejected)
- (4) 如果委托量是 4/400/4000, 状态为 部分成交(有 3 笔成交记录)
- (5) 如果委托量是 6/600/6000, 状态为 全部成交(有 3 笔成交记录)

下面是针对测试用例《外部系统接入测试表》的模板, 进行参考。

具体实现方式请参考交易 API 介绍: <https://www.zvsts.com/api>

1. 买入指令:
交易所 ID: HKEX, 股票代码: 00700, 买卖方向: BUY, 委托数量: 600, 订单类型: 增强限价, 委托价: 10
2. 卖出指令:
交易所 ID: HKEX, 股票代码: 00700, 买卖方向: SELL, 委托数量: 600, 订单类型: 增强限价, 委托价: 10
3. 撤单指令:
委托买入 200 股, 这时会部分成交 100 股。执行撤单 100 股的请求
4. 市价指令:
参考测试用例 1, 订单类型修改为“市价” (Market)
5. 限价指令:
参考测试用例 1, 订单类型修改为“限价” (Limit)
6. MOA 指令:
参考测试用例 1, 订单类型修改为“港股竞价单” (type=Market 同时 tif=AC)
7. LOA 指令:
参考测试用例 1, 订单类型修改为“港股竞价限价单” (type= Limit 同时 tif=AC)

8. 资金变化情况：
下单前，执行获取资金请求/query/account，保存截图
下单后，执行获取资金请求/query/account，保存截图
9. 持仓变化情况：
买入 600 股 00700，股票成交后，执行查询持仓请求/query/position，保存截图
卖出 200 股 00700，股票成交后，执行查询持仓请求/query/position，保存截图
10. 风控情况说明：
 - 买入一笔大于可用资金的委托，比如委托价 10000，委托数量 100000，买入 00700，得到 Error message: No Enough Buying Power
 - 截图保存
11. 自成交控制：
 - 用 12 元的价格，买入 600 股的 00700 股票，这时持仓显示有 600 股 00700
 - 以 10 元的价格，委托卖出 200 股 00700，这时卖出订单会部分成交 100 股，还有 100 股委托已报
 - 再以 10 元的价格委托 200 股的 00700 买入，得到 Error message: Self Trade Blocked
 - 保存截图

完成上述测试后，请发送测试用例 1-7 的 Log 文件，以及测试用例 8-11 的截图文件给尊嘉客服邮箱 cszg@zvsthk.com。经过客服审核后，会开通 API 的生产环境交易权限。