

程式交易尽职调查问卷

| 第一部分 基本情况调查 | | | |
|---|---|--------------------------------|---|
| 系统名称 | | | |
| 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 | | | |
| 主要交易产品 | | | |
| 资金来源 | | | |
| 已(拟) 运作程序交易策略数量 (如适用) | | | |
| 适用市场及产品 | | | |
| 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 | | |
| 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 | | | |
| 最大持仓限制 | | 单笔最大下单量 | |
| 订单流量上限 | 笔/秒 | 日内亏损限额 | |
| 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 | | | |
| 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。 | | | |
| <div style="display: flex; justify-content: space-between;"> <div>客户签署（及/或盖章）：</div> <div>签署日期：</div> </div> | | | |

