

股票期权系统程序化交易接入指引

1. 公司正式期权客户向证券业务部申请我司上交所全真环境账号（CTP 股票期权系统）用于接入测试。
2. 客户在获得全真帐户后，填写测试申请表，发送邮件到我司技术部邮箱 it_support@nawaa.com 申请程序化交易接入测试。详见附件一：《股票期权程序化接入测试申请表》。
3. 我司技术部门核实客户正式身份后，向客户邮箱反馈分配信息。详见附件二：《全真环境测试信息分配表》。
4. 客户根据我司技术部门提供的每周的特定时间窗口，以邮件通知的方式举手，与技术部门约定测试时间。
5. 客户按要求完成测试表单中的各项测试内容，并填写《股票期权系统程序化交易接入测试认证表 A》（详见附件三），技术部门做复核确认，并填写《股票期权系统程序化交易接入测试认证表 B》（详见附件四）。
6. 客户根据技术部门复核记录，作为通过全真交易测试的依据向我司正式提交生产系统的程序化接入申请。并提交包括但不限于《股票期权程序化交易准入协议》（详见附件五）、《承诺函》（详见附件六）、《股票期权程序化交易接入测试申请表》、《程序化交易情况登记表》（详见附件七）、《股票期权系统程序化交易接入测试认证表 A》等满足报备要求的所有申请材料。
7. 根据公司流程，证券业务部和合规部必须审核客户提交的材料，

符合条件的予以报备，不符合的返还客户进行补充。

8. 通过交易所报备申请后，客户正式接入前，必需提前一个工作日通知我司。由我司技术部门发放用户端产品信息(**userproductinfo**)和认证码(**authcode**)，次日授权许可方可正式生效。技术部门可对一个月未交易的程序化接入采取临时关闭接入措施，客户需要重新启用的，必须提前一个工作日通知我司更新授权码。
9. 生产环境接入完成。

股票期权程序化交易接入测试申请表

基本信息	客户姓名	客户全真账户
	联系电话	接入IP和mac地址
	业务发起部门/发起人	发起人联系方式
接入方简介	接入方名称	产品名称和版本
	支持的交易接口和交易品种	产品实盘交易上线时间
	核心功能特点：	
接入项目介绍	系统情况：系统架构和部署图	
	系统功能：行情接入，交易委托、撤单、成交处理说明	
	核心风控：控制自成交、频繁报撤单的功能说明，控制业务逻辑说明	

全真环境测试信息分配表

客户姓名	客户全真账户
南华期货对接技术工程师	联系方式
对接的全真系统及版本	
用户端产品信息 (userproductinfo)	用户端认证码authcode
备注：API接口下载，接入测试地址端口等说明见我司网站www.nanhua.net-软件下载-API及第三发软件接口	

股票期权系统程序化交易接入测试认证表 A

--客户填写

测试日期：__年__月__日			
客户名称		客户号（期权+ 现货）	
外部接入程序/ 系统名称及版本号			
接入 ip 及 mac 地址			
接入地点			
接入测试系统 名称及版本号			
期权测试内容			
测试步骤	是否使用强制认证码登录		是 <input type="checkbox"/> 否 <input type="checkbox"/> 未测 <input type="checkbox"/>
	认证码登录是否正常		是 <input type="checkbox"/> 否 <input type="checkbox"/> 未测 <input type="checkbox"/>
	行情接收是否正常		是 <input type="checkbox"/> 否 <input type="checkbox"/> 未测 <input type="checkbox"/>
	交易买卖类型 (正常、异常、未测)	买入开仓	是 <input type="checkbox"/> 否 <input type="checkbox"/> 未测 <input type="checkbox"/>
		买入平仓	是 <input type="checkbox"/> 否 <input type="checkbox"/> 未测 <input type="checkbox"/>
		卖出开仓	是 <input type="checkbox"/> 否 <input type="checkbox"/> 未测 <input type="checkbox"/>
		卖出平仓	是 <input type="checkbox"/> 否 <input type="checkbox"/> 未测 <input type="checkbox"/>
		备兑开仓 *	是 <input type="checkbox"/> 否 <input type="checkbox"/> 未测 <input type="checkbox"/>
		备兑平仓 *	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)	限价	是 <input type="checkbox"/> 否 <input type="checkbox"/> 未测 <input type="checkbox"/>
		市价剩余转限价 *	是 <input type="checkbox"/> 否 <input type="checkbox"/> 未测 <input type="checkbox"/>
		市价剩余转撤销 *	是 <input type="checkbox"/> 否 <input type="checkbox"/> 未测 <input type="checkbox"/>
		FOK *	是 <input type="checkbox"/> 否 <input type="checkbox"/> 未测 <input type="checkbox"/>
		FAK *	是 <input type="checkbox"/> 否 <input type="checkbox"/> 未测 <input type="checkbox"/>
		限价撤单	是 <input type="checkbox"/> 否 <input type="checkbox"/> 未测 <input type="checkbox"/>
	非交易指令 (正常、异常、未测)	行权 *	是 <input type="checkbox"/> 否 <input type="checkbox"/> 未测 <input type="checkbox"/>
		行权撤销 *	是 <input type="checkbox"/> 否 <input type="checkbox"/> 未测 <input type="checkbox"/>
		证券锁定 *	是 <input type="checkbox"/> 否 <input type="checkbox"/> 未测 <input type="checkbox"/>
证券解锁 *		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"/>
	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*号为接入认证测试非必需项，其它项目必需全部测试通过。 2、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）		

证券测试内容			
测试步骤	是否使用强制认证码登录	是 <input type="checkbox"/> 否 <input type="checkbox"/> 未测 <input type="checkbox"/>	
	认证码登录是否正常	是 <input type="checkbox"/> 否 <input type="checkbox"/> 未测 <input type="checkbox"/>	
	行情接收是否正常	是 <input type="checkbox"/> 否 <input type="checkbox"/> 未测 <input type="checkbox"/>	
	交易买卖类型（正常、异常、未测）	买入开仓	是 <input type="checkbox"/> 否 <input type="checkbox"/> 未测 <input type="checkbox"/>
		买入平仓	是 <input type="checkbox"/> 否 <input type="checkbox"/> 未测 <input type="checkbox"/>
		卖出开仓	是 <input type="checkbox"/> 否 <input type="checkbox"/> 未测 <input type="checkbox"/>
		卖出平仓	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）	市价剩余撤消	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"/>	
风控是否正常	是 <input type="checkbox"/> 否 <input type="checkbox"/> 未测 <input type="checkbox"/>		
测试中遇到的问题			
测试结果（评估）			

客户签名：

日期：

股票期权系统程序化交易接入测试认证表 B

--公司填写

测试日期：__年__月__日			
客户名称		客户号（期权+ 现货）	
外部接入程序/ 系统名称及版本号			
接入 ip 及 mac 地址			
接入地点			
接入测试系统 名称及版本号			
期权测试内容			
测试步骤	是否使用强制认证码登录		是 <input type="checkbox"/> 否 <input type="checkbox"/> 未测 <input type="checkbox"/>
	认证码登录是否正常		是 <input type="checkbox"/> 否 <input type="checkbox"/> 未测 <input type="checkbox"/>
	行情接收是否正常		是 <input type="checkbox"/> 否 <input type="checkbox"/> 未测 <input type="checkbox"/>
	交易买卖类型 (正常、异常、未测)	买入开仓	是 <input type="checkbox"/> 否 <input type="checkbox"/> 未测 <input type="checkbox"/>
		买入平仓	是 <input type="checkbox"/> 否 <input type="checkbox"/> 未测 <input type="checkbox"/>
		卖出开仓	是 <input type="checkbox"/> 否 <input type="checkbox"/> 未测 <input type="checkbox"/>
		卖出平仓	是 <input type="checkbox"/> 否 <input type="checkbox"/> 未测 <input type="checkbox"/>
		备兑开仓 *	是 <input type="checkbox"/> 否 <input type="checkbox"/> 未测 <input type="checkbox"/>
		备兑平仓 *	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)	限价	是 <input type="checkbox"/> 否 <input type="checkbox"/> 未测 <input type="checkbox"/>
		市价剩余转限价 *	是 <input type="checkbox"/> 否 <input type="checkbox"/> 未测 <input type="checkbox"/>
		市价剩余转撤销 *	是 <input type="checkbox"/> 否 <input type="checkbox"/> 未测 <input type="checkbox"/>
		FOK *	是 <input type="checkbox"/> 否 <input type="checkbox"/> 未测 <input type="checkbox"/>
		FAK *	是 <input type="checkbox"/> 否 <input type="checkbox"/> 未测 <input type="checkbox"/>
		限价撤单	是 <input type="checkbox"/> 否 <input type="checkbox"/> 未测 <input type="checkbox"/>
	非交易指令 (正常、异常、未测)	行权 *	是 <input type="checkbox"/> 否 <input type="checkbox"/> 未测 <input type="checkbox"/>
		行权撤销 *	是 <input type="checkbox"/> 否 <input type="checkbox"/> 未测 <input type="checkbox"/>
		证券锁定 *	是 <input type="checkbox"/> 否 <input type="checkbox"/> 未测 <input type="checkbox"/>
证券解锁 *		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"/>
	风控是否正常，是否无自成交、频繁报撤单等预警	是 <input type="checkbox"/> 否 <input type="checkbox"/> 未测 <input type="checkbox"/>
备注：测试内容带*号为接入认证测试非必需项，其它项目必需全部测试通过。		
测试中遇到的问题		
测试结果（评估）		

证券测试内容			
测试步骤	是否使用强制认证码登录	是 <input type="checkbox"/> 否 <input type="checkbox"/> 未测 <input type="checkbox"/>	
	认证码登录是否正常	是 <input type="checkbox"/> 否 <input type="checkbox"/> 未测 <input type="checkbox"/>	
	行情接收是否正常	是 <input type="checkbox"/> 否 <input type="checkbox"/> 未测 <input type="checkbox"/>	
	交易买卖类型（正常、异常、未测）	买入开仓	是 <input type="checkbox"/> 否 <input type="checkbox"/> 未测 <input type="checkbox"/>
		买入平仓	是 <input type="checkbox"/> 否 <input type="checkbox"/> 未测 <input type="checkbox"/>
		卖出开仓	是 <input type="checkbox"/> 否 <input type="checkbox"/> 未测 <input type="checkbox"/>
		卖出平仓	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）	市价剩余撤消	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"/>		
测试中遇到的问题			
测试结果（评估）			

测试人签名：

日期：

承诺函

致南华期货股份有限公司：

本人/本机构与贵司签订了期货经纪合同，遵守开户实名制要求，以合法自有或管理的资金开立了期货账户，严格按照中国证监会及各期货交易所的相关规定，合法合规地进行各项期货交易，愿意配合监管部门及贵司完成相关检查。同时，本人/本机构郑重承诺不直接或间接进行下列活动：

- (1) 出借本人/本机构账户给其他个人或机构使用；
- (2) 在交易账户下设子账户、分账户等虚拟账户违规进行期货交易；
- (3) 从事或变相从事场外配资活动；
- (4) 为其他机构或个人非法从事期货交易提供便利；
- (5) 提供虚假证明材料，隐瞒尽职调查信息；
- (6) 其他法律法规、监管规定和自律规则禁止的行为。

若本人/本机构违反本承诺函或监管规定的，贵司有权采取拒绝委托、关闭接入等相应处置措施，由此产生的后果由本人/本机构承担全部责任。

承诺人：

年 月 日

股票期权程序化交易情况登记表

账户信息			
客户姓名:		客户号:	
交易地点 (可多选)	证券	<input type="checkbox"/> 上证所 <input type="checkbox"/> 深交所	
	期货	<input type="checkbox"/> 上期所 <input type="checkbox"/> 中金所 <input type="checkbox"/> 郑州 <input type="checkbox"/> 大连	
联系电话:		地址:	
合约账户(如有多个账户, 请列表)			
账户类型	<input type="checkbox"/> 个人 <input type="checkbox"/> 自营 <input type="checkbox"/> 做市商 <input type="checkbox"/> 一般机构 <input type="checkbox"/> 其他类型:		
交易信息			
交易接入点:	<input type="checkbox"/> 公网接入 <input type="checkbox"/> 托管接入 <input type="checkbox"/> 专线接入等方式		
程序化交易资金来源			
交易资产规模			
系统技术配置参数			
系统服务器所在地址			
委托报单数量:	笔/天(峰值)	笔/天(均值)	
撤单数量:	笔/天(峰值)	笔/天(均值)	
成交数量:	笔/天(峰值)	笔/天(均值)	
交易模式 (可多项勾选)	<input type="checkbox"/> 日内高频交易 <input type="checkbox"/> 人工下单 <input type="checkbox"/> 软件自动下单 <input type="checkbox"/> 日内非高频交易 <input type="checkbox"/> 隔夜交易 <input type="checkbox"/> 期权市场 <input type="checkbox"/> 期现市场 <input type="checkbox"/> 期货市场 <input type="checkbox"/> 其它类型(填写):		
程序化交易品种:	请填写您程序化交易的品种:		
备注:	1、客户知晓使用程序化软件的风险, 并且由客户自己承担由于程序化软件产生的交易风险, 并且签署和知晓南华期货股份有限公司非标协议。 2、客户有义务协助我司和交易所在必要时进行的程序化软件测试工作和遵守交易所对于委托量、成交量、撤单量等异常交易处理规定。		

客户签名:

日期: