附件1-3

深圳证券交易所深股通投资者程序化交易报告信息填报注意事项

为确保深股通投资者程序化交易报告信息符合相关填报规范要求，避免提交失败，请重点关注下列填报注意事项：

一、程序化交易报告文件格式及命名规范

报告以增量方式进行，此前已成功上传的账户无需重复报告。每个深股通交易日，联交所参与者将当日报告信息汇总形成《深圳证券交易所深股通投资者程序化交易信息报告表》（以下简称《信息报告表》）后，通过指定路径提交至联交所。如报告账户中包含高频交易账户的，须同步提交高频交易系统测试报告和故障应急方案。如包含高频交易账户但存在《深圳证券交易所证券交易业务指引第3号——深股通投资者程序化交易报告》（以下简称《报告指引》）规定的豁免额外报告情形，须提交相关证明文件的，应同步提交。

上述文件均分别压缩为zip格式文件（压缩包）提交。具体提交路径及规范性要求由联交所另行规定。上述文件的格式、命名规范及压缩包命名规范详见表1。

**表1：各类报告文件的格式及命名规范要求**

| **序号** | **文件类型** | **文件格式** | **文件格式及命名规范** | **zip文件（压缩包）命名规范** |
| --- | --- | --- | --- | --- |
| 1. | 《信息报告表》 | xlsx | SZ\_PGTDRPT\_\*\*\*\*\*\_YYYYMMDD.xlsx  该excel文件中仅能包含一个工作簿（sheet） | SZ\_PGTDRPT\_\*\*\*\*\*\_YYYYMMDD.zip  该zip文件中仅能包含1个excel文件 |
| 2. | 高频交易系统测试报告及故障应急方案（如适用） | pdf | （1）测试报告：SZ\_HFTRPTST\_\*\*\*\*\*\_XXXXXXXXXX\_YYYYMMDD.pdf  （2）应急方案：SZ\_HFTRPCTG\_\*\*\*\*\*\_XXXXXXXXXX\_YYYYMMDD.pdf | SZ\_HFTRP\_\*\*\*\*\*\_YYYYMMDD.zip  该zip文件中可包含多个账户的高频交易额外报告文件 |
| 3. | 特定主体达到高频交易标准，申请豁免额外报告的证明文件（如适用） | pdf | （1）对于仅发行公众基金的基金管理人，应当提交豁免申请表和香港证监会受规管活动第9类提供资产管理的牌照，命名格式分别为：SZ\_HFTEXAPP\_\*\*\*\*\*\_XXXXXXXXXX\_YYYYMMDD.pdf、SZ\_HFTEXLCC\_\*\*\*\*\*\_XXXXXXXXXX\_YYYYMMDD.pdf  （2）对于从事资产管理业务且符合相关要求的联交所参与者，应当提交豁免申请表和香港证监会受规管活动第9类提供资产管理的牌照，命名格式分别为：SZ\_HFTEXAPP\_\*\*\*\*\*\_XXXXXXXXXX\_YYYYMMDD.pdf、SZ\_HFTEXLCP\_\*\*\*\*\*\_XXXXXXXXXX\_YYYYMMDD.pdf | SZ\_HFTEX\_\*\*\*\*\*\_YYYYMMDD.zip  该zip文件中可包含多个账户的申请豁免证明文件 |

说明：\*\*\*\*\*为联交所分配的5位经纪商代码，XXXXXXXXXX为联交所参与者向投资者编派的券商客户编码，YYYY表示年份，MM表示月份，DD表示日期，需与向联交所提交报告当日日期相符。文件名称、格式等不符合上述要求的均会导致提交失败。

二、程序化交易报告语言要求

对于描述类字段（主策略概述、辅策略概述、指令执行方式概述等）以及高频交易系统测试报告和故障应急方案，填报语言原则上为简体中文。对于个别难以确定统一中文表述的字段，例如联交所参与者名称、账户名称、程序化交易软件名称等，可以填写英文。

三、程序化交易信息报告表填写规范要求

请从深圳证券交易所官网（www.szse.cn）《报告指引》附件或者联交所官网指定链接下载填报模板（《信息报告表》）填写，切勿对模板中除示例以外的其他内容、格式做任何调整，否则无法提交。请严格按照表2填写规范要求填写各个字段，否则会导致zip文件无法提交，需根据返回的错误提示修改相关内容后重新提交。

**表2：《信息报告表》各字段填写规范要求**

| **序号** | **字段名** | **长度** | **填写规范要求**  **（所有字段均用文本格式填写）** |
| --- | --- | --- | --- |
|  | 联交所参与者名称 | C100 | **必填项**；填写联交所参与者全称。  若上传报告表的联交所参与者与执行交易的联交所参与者不同，应当填写执行交易联交所参与者的公司全称。 |
|  | 经纪商代码 | C5 | **必填项**；固定五位数字，一般以0开头。位数不对或者无法在本所系统中查询到对应代码将无法提交。  若上传报告表的联交所参与者与执行交易的联交所参与者不同，应当填写执行交易联交所参与者的经纪商代码。 |
|  | 账户名称 | C200 | **必填项**；填写账户名称的全称。 |
|  | 证件号码 | C80 | **必填项**；填写投资者登记券商客户编码时的证件号码，例如机构投资者填写LEI码。 |
|  | 产品编码（选填） | C50 | 选填。 |
|  | 深市券商客户编码 | C10 | **必填项；**  （1）填写联交所参与者向深股通程序化交易投资者编派的唯一券商客户编码。编码位数最短3位，最长10位，将与本所系统中的编码进行核对，位数不对或者无法在本所系统中查询到对应编码将无法提交。  （2）同一日上传的文件中，同一券商客户编码只能报一条记录，不能重复出现，否则将无法提交。 |
|  | 产品管理机构名称 | C200 | 选填；如为产品账户，请填写该产品管理人全称。 |
|  | 报告类型（首次/变更/停止使用） | C6 | **必填项**；只能填写“首次”或者“变更”或者“停止使用”中的一个，否则无法提交。  （1）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”；停止进行程序化交易报告的，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报告信息。  （3）报告类型为“停止使用”的，仅须填写“账户基本信息”中联交所参与者名称、经纪商代码、账户名称、券商客户编码、报告日期5个字段（B、C、D、G、J列），报告表其他字段可留空。  （4）填写“首次”的，最近一次的报告类型必须是“停止使用”或未报告过；填写“变更”的，最近一次的报告类型必须是“首次”或“变更”；填写“停止使用”的，最近一次的报告类型必须是“首次”或“变更”。 |
|  | 报告日期 | C10 | **必填项**；按照“YYYY/MM/DD”的格式填写，使用文本格式，否则无法提交。示例“2025/05/06”。填写的报告日期不得晚于提交报告表的日期，否则无法提交。 |
|  | 是否选取一家联交所参与者集中填报资金信息 | C1 | **必填项**；只能根据实际填报情况填写“是”或“否”，填写其他内容将无法提交。 |
|  | 账户资金规模（人民币，万元） | C30 | **必填项**；小数部分最大2位，兼容整数，总长度不超过30位。请留意填写单位为“人民币，万元”。  如选择一家联交所参与者填报资金信息，向其他参与者报告时，此字段填写“已在其他联交所参与者报告”。 |
|  | 账户资金来源 | C100 | **必填项**；可以填入以下的一项或者多项，若多项用“;”（英文分号）隔开，例如“自有资金;其他（XXX）”。   * 自有资金 * 募集资金 * 杠杆资金 * 其他（XXX）   填写“其他”的，需在“其他”后面加括号填写具体来源，格式为“其他（XXX）”，否则无法提交。  请严格按照上述四类资金来源类别填写，否则无法提交。  如选择一家联交所参与者填报资金信息，向其他参与者报告时，此字段填写“已在其他联交所参与者报告”。 |
|  | 资金来源占比（%） | C200 | **必填项**；  （1）严格按照“账户资金来源XX%”的方式填写，账户资金来源内容须与前一字段一致。例如，账户资金来源填写了“自有资金”，则资金来源占比填写“自有资金100%”。  （2）如存在多个资金来源，需填写不同资金来源的占比，用“;”（英文分号）分隔，资金来源内容须与账户资金来源填写内容一致。例如，账户资金来源填写了“自有资金;募集资金;其他（XXX）”，则资金来源占比填写“自有资金70%;募集资金20%;其他10%”。  （3）资金来源内容与前一字段不符或者占比之和不等于100%均无法提交。  如选择一家联交所参与者填报资金信息，向其他参与者报告时，此字段填写“已在其他联交所参与者报告”。 |
|  | 杠杆资金规模（人民币，万元） | C30 | （1）**如账户资金来源包含“杠杆资金”则必填**，否则可留空；  （2）小数部分最大2位，兼容整数，总长度不超过30位，请留意填写单位为“人民币，万元”；  （3）填写的杠杆资金规模不应超过账户资金规模，否则无法提交。  如选择一家联交所参与者填报资金信息，向其他参与者报告时，此字段填写“已在其他联交所参与者报告”。 |
|  | 杠杆资金来源 | C100 | （1）**如账户资金来源包含“杠杆资金”则必填**，否则可留空；  （2）可以填入以下的一项或者多项，若多项用“;”（英文分号）隔开，例如“融资融券;场外衍生品”。   * 融资融券 * 场外衍生品 * 其他（XXX）   填写“其他”的，需在“其他”后面加括号填写具体来源，例如“其他（个人借贷）”，否则无法提交。  （3）如选择一家联交所参与者填报资金信息，向其他参与者报告时，此字段填写“已在其他联交所参与者报告”。 |
|  | 杠杆率（%） | C20 | （1）**如账户资金来源包含“杠杆资金”则必填**，否则留空；  （2）杠杆率计算方式为：截至报告日期账户中（总资产规模/净资产规模）\*100%。存在杠杆资金的，杠杆率应当大于100%，如填报数值小于100，将无法提交。  （3）直接填写数字，无需填写百分号，例如杠杆率为300%则填写“300”，小数部分最大2位，兼容整数，总长度不超过9位，否则无法提交。  （4）如选择一家联交所参与者填报资金信息，向其他参与者报告时，此字段填写“已在其他联交所参与者报告”。 |
|  | 交易品种 | C20 | **必填项；**可以填入以下的一项或者多项，若多项用“;”（英文分号）隔开：   * 股票 * 基金 |
|  | 是否量化交易 | C1 | **必填项；**只能填“是”或者“否” |
|  | 主策略类型 | C20 | **如“是否量化交易”填“是”，此字段为必填项**。只能选取以下一项填写：   * 指数增强策略 * 市场中性策略 * 多空灵活策略 * 量化多头策略 * 管理期货策略（CTA） * 参与新股发行策略 * 量化套利策略 * 日内回转策略 * 其他（XXXX）   填写“其他”的，在其他后面加括号填写策略名称，例如“其他（收益互换对冲）”，否则无法提交。 |
|  | 主策略概述 | C500 | **如“是否量化交易”填“是”，此字段为必填项**。 |
|  | 辅策略类型 | C100 | 选填。  可填写以下任一项或最多两项，若两项中间用“;”（英文分号）隔开：   * 指数增强策略 * 市场中性策略 * 多空灵活策略 * 量化多头策略 * 管理期货策略（CTA） * 参与新股发行策略 * 量化套利策略 * 日内回转策略 * 其他（XXXX）   填写“其他”的，在其他后面加括号填写策略名称，否则无法提交。 |
|  | 辅策略概述 | C500 | 选填。 |
|  | 期货市场账户名称（选填） | C200 | 选填。 |
|  | 期货市场账户代码（选填） | C300 | 选填。 |
|  | 交易指令执行方式 | C100 | **必填项；**可以填入以下的一项或者多项，若多项用“;”（英文分号）隔开：   * VWAP * TWAP * POV * 其他方式（XXXX）   填写“其他方式”的，在其他后面加括号填写其他交易指令执行方式，例如“其他方式（拆单交易）”，否则无法提交。 |
|  | 交易指令执行方式概述 | C500 | **必填项**。 |
|  | 账户最高申报速率（笔/秒） | C20 | **必填项；**只能填入以下一项：   * 500 * 300-500 * 100-300 * 0-100   严格按上述选项填写，否则无法提交。例如账户最高申报速率为400笔/秒，则填写“300-500”。 |
|  | 账户单日最高申报笔数（笔） | C20 | **必填项；**只能填入以下一项：   * 25000 * 20000-25000 * 15000-25000 * 10000-15000 * 0-10000   严格按上述选项填写，否则无法提交。例如账户单日最高申报笔数为30000笔/天，则填写“25000”。 |
|  | 程序化交易软件名称及版本号 | C200 | **必填项；**涉及多个软件，用“;”（英文分号）分隔 |
|  | 程序化交易软件开发主体 | C200 | **必填项；**涉及多个主体，用“;”（英文分号）分隔 |
|  | 高频交易系统服务器所在地 | C100 | （1）**如满足以下条件之一，该字段必填**，填写程序化交易系统服务器所在具体地址。具体地址应为可查询的具体地点。   * “账户最高申报速率”填写了“500”或“300-500”； * “账户单日最高申报笔数”填写了“25000”或“20000-25000”；   （2）如存在上述情形，但符合《报告指引》第七条规定的豁免情形，在本字段填写“已申请豁免”。  （3）如不满足以上必填情形则留空。 |
|  | 联交所参与者联络人（选填） | C80 | 选填。 |
|  | 联交所参与者联络人联系方式（选填） | C80 | 选填。 |
|  | 投资者相关业务负责人（选填） | C80 | 选填。 |
|  | 投资者相关业务负责人联系方式（选填） | C80 | 选填。 |
|  | 是否上传测试报告及应急方案 | C5 | （1）**如满足以下条件之一，该字段必填**，且只能填写“是”或“已申请豁免”。   * “账户最高申报速率”填写了“500”或“300-500”； * “账户单日最高申报笔数”填写了“25000”或“20000-25000”；   （2）如存在上述情形，且不符合有关豁免要求的，填写“是”并同步上传测试报告及应急方案；如符合《报告指引》第七条规定的豁免情形，在本字段填写“已申请豁免”。  （3）若不满足以上必填情形，则留空。 |
|  | 合格境外投资者编码 | C50 | **具有合格境外投资者资格的投资者拟适用拆单条款豁免高频额外报告的，则必填**，否则可不填。 |