

关于投资者主动履程序化交易报备义务的公告

尊敬的投资者：

2023年9月，沪深北三地交易所分别下发了《关于股票程序化交易报告工作有关事项的通知》和《关于加强程序化交易管理有关事项的通知》，明确了程序化交易的定义并确定了报告主体范围。

一、程序化交易定义

程序化交易指通过计算机程序自动生成或者下达交易指令在交易所进行证券交易的行为，包括按照设定的策略自动选择特定的证券和时机进行交易的量化交易，或者按照设定的算法自动执行交易指令的算法交易以及其他符合程序化交易特征的行为。

二、满足以下条件之一的，应当履行报告义务：

(1) 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。

(2) 申报速率快。1天出现10次以上1秒钟内10笔以上申报（含撤单申报）的程序化交易投资者。

(3) 交易股票只数多、换手率高。最近30个交易日日均交易沪市股票不少于50只，且最近30个交易日年化换手率在30倍以上的程序化交易投资者。

(4) 使用自主研发或其他定制软件的程序化交易投资者。

(5) 交易所认定的其他需要报告的情形。

注：年化换手率=该账户（最近30个交易日沪市日均交易金额）/（最近30个交易日沪市日均持仓金额）×当年交易日天数

三、进行以下交易品种的程序化交易，应事前主动向我司报备交易所规定的信息要素：

“股票”、“基金”、“存托凭证”或其他交易所通知的品种。

具体的报备内容及要求按照交易所《关于股票程序化交易报告工作有关事项的通知》执行，如有相关问题，可与我司进行联系。

满足上述条件的投资者，应在交易开始前主动向我司报告并按照我司的要求知悉、确认和/或签署关于投资者开展程序化交易的补充协议。经我司督促后仍不按要求报告、确认和/或签署补充协议的投资者，我司有权拒绝接受其程序化交易委托。

汇丰前海证券有限责任公司

2023 年 11 月 6 日