

## 关于加强 2017 年“两会”期间期权程序交易管理的通知

各期权经营机构:

全国“两会”将于 3 月 3 日至 15 日在北京召开。为保证“两会”期间期权市场的安全运行,请各期权经营机构在此期间加强对程序交易的管理工作:

一、高度重视“两会”期间程序交易的安全保障工作。“两会”保障期间,除非确有必要,所有期权经营机构和客户原则上暂停程序交易相关系统的重大更新和策略调整。如确需进行更新或重大策略调整,应提前 3 个工作日向我部进行报备,并做好风险管理工作;

二、“两会”保障期间,期权业务团队(包括经纪业务、自营业务等)重要岗位人员如负责人、风控人员等原则上不能离岗,并应保持通信联络畅通。同时,明确备岗人员,确保备岗人员能随时到岗;

三、“两会”保障期间,各期权经营机构应加强程序交易突发事件预防与管理,如发生突发事件,应严格根据应急预案进行处置,并及时向我部报备。

特此通知。

上海证券交易所产品创新中心

二〇一七年三月二日