附件1：外接系统尽职调查评估表

**外接系统尽职调查评估表**

年 月 日

|  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- |
| **客户基本情况** | | | | | |
| （接入方指与公司直接建立系统对接的机构或个人）  接入方全称：  接入方类型：□基金公司 □基金子公司 □信托公司 □券商 □券商子公司 □期货子公司 □ 备案私募机构 □银行 □保险公司 □自然人 □信息系统第三方接入服务提供商 □其他机构（请注明： ） | | | | | |
| 资金账号 | |  | 客户名称 |  | |
| 客户联系电话 | |  | 软件交易地点 |  | |
| 风险等级 | |  | 财务状况 |  | |
| 资金来源 | |  | 资金规模 |  | |
| 近三年经营状况 | |  | | | |
| 主要从事的业务描述（可多选） | | □资管产品 □量化投资 □资金存管 □行情服务 □场外配资 □其他（请注明： ） | | | |
| 仅限产品客户填写 | | 产品结构：□非结构化 □结构化 杠杆（倍数）：  产品备案情况：□已备案 □未备案 产品托管人：  是否代销：□是 □否 | | | |
| 仅限机构客户填写 | | 公司网址： | | | |
| 策略概况 | |  | | | |
| **外接系统情况** | | | | | |
| 外接系统名称及版本号 |  | | 外接系统开发模式 | □采购 □租用  □自行开发 | |
| 外接系统开发者名称 |  | | 是否程序化 | □是 □否 | |
| 技术联系人及联系方式 |  | | 交易建立连接数 |  | |
| AppID/RelayAppID |  | | 接入模式 |  | |
| 是否允许其他机构再次接入 | □是 □否 | | 外接系统是否具有分仓功能 | □不支持 □支持，预计开设子账号数量： | |
| 是否与境外计算机连接 | □是 □否 | | 是否受境外计算机远程控制 | □是 □否 | |
| 外接系统接入我司方式 | □互联网  □专线（运营商及线路编号： ）  □VPN  □局域网（□服务器托管 □应用托管）  □其他方式（请注明： ） | | | | |
| 系统运营 | □自主运营 □委托第三方机构运营 □委托公司运营 | | | | |
| 软件基本功能（可多选） | □自动开/平仓 □止盈/止损功能 □批量下单功能 □多账户管理 □套利/组合套利 □交易模型编写 □一键/快捷下单 □组合/条件预埋单 □日内短线  □其他（请注明： ） | | | | |
| 压力测试数据 | 支持最大客户数量 、支持最大并发连接数 、单位时间最大报单笔数 | | | | |
| 软件是否具有监控链接异常断开情形 | □有 □没有 □没有，准备实现 | | | | |
| 交易概况 | 交易模式：□人工手工下单/□软件自动下单（二选一）  □交易服务器托管/□交易服务器不托管（二选一）  □组合交易 □隔夜交易 □高频交易 □其他（请注明： ）  是否有独立使用交易席位的需求：□否 □是，请注明交易所：  是否有接入交易所深度行情需求：□否 □是，请注明交易所：  策略类型：□套保 □套利 □投机  具体策略：□阿尔法策略（择股） □阿尔法策略（择时） □ETF套利 □期指套利 □期权套利 □统计套利 □算法交易 □日内套利 □资产配置 □其他（请注明： ）  软件发送委托交易指令的终端是否具有报送实际IP地址、MAC地址、硬盘序列号、CPU序列号等信息能力：□有 □没有 □没有，准备实现  软件遇重大升级或变更，是否配有专人进行测试与评估：  □没有 □有，请提供联系人/联系方式：  数据来源：  预估软件每秒订单峰值：  预估软件每秒单位时间查询次数：  软件合规风险控制类说明：    软件是否经过上线前测试评估 □没有 □有，请注明具体情况（或提供测试报告）：    以附件形式提供软件架构、网络拓补和功能设计等相关资料。 | | | | |
| 是否具备下列风险控制功能：  （一）系统标识功能，能够标识系统名称，并被期货公司系统识别；□是 □否  （二）验资、验券、持仓验证功能，能够在指令发出前进行资金和持仓等验证，并拒绝未通过验证的申报指令；□是 □否  （三）流量控制功能，能够对系统申报、撤单数量进行限制；□是 □否  （四）异常指令检测功能，能够识别申报价格和数量异常的指令；□是 □否  （五）错单处理功能，具有暂停、快速撤销指令或切断开关功能；□是 □否  （六）日志保存功能，具备交易、业务操作日志保存功能，日志格式和存放形式应当满足期货公司核查的要求。□是 □否  （七）其它风控控制功能，请说明： | | | | | |
| **服务器托管** | | | | | |
| 是否托管 | □是 □否 | | 托管费用 | |  |
| 托管服务器的品牌型号、序列号 |  | | 托管服务器是否双电 | | □是 □否 |
| 托管起止日期 |  | |  | |  |
| 申请部门意见：（涉及程序化请按以下标准进行测试评估）  （一）在同一账户或同一客户实际控制的账户组间，进行期货合约的自买自卖；□是 □否  （二）不以成交为目的，频繁申报并撤销申报，或者大额申报并撤销申报； □是 □否  （三）以涨跌停板价格频繁申报并撤销申报，或者大额申报并撤销申报； □是 □否  （四）进行申报价格持续偏离申报时市场成交价格的大额申报并撤销申报，同时进行小额多笔反向申报并成交； □是 □否  （五）连续申报或密集申报，可能引发价格快速上涨或下跌，或者引导、强化期货合约交易价格趋势； □是 □否  （六）在收盘阶段利用程序进行大量或连续交易； □是 □否  （七）预计资金规模\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_  部门负责人： 年 月 日 | | | | | |
| 交易客服部意见：  部门负责人： 年 月 日 | | | | | |
| 技术部意见：（对公司系统稳定情况、费用情况等方面评估）  1、对公司系统是否有潜在影响或风险隐患； □是 □否  2、是否产生费用； □是 □否  部门负责人： 年 月 日 | | | | | |
| 合规部意见：  签字： 年 月 日 | | | | | |
| 首席风险官审批：  签字： 年 月 日 | | | | | |
| 分管技术副总审批：  签字： 年 月 日 | | | | | |
| 公司总经理审批：  签字： 年 月 日 | | | | | |