**天风期货股份有限公司**

**外部接入信息系统管理办法**

**第一章 总 则**

**第一条** 为进一步加强公司信息系统外部接入的风险管理，维护公司信息系统安全、稳定运行，有效防范风险，促进业务发展，根据监管要求、交易所相关规定和公司管理需要特制订本办法（以下简称“本办法”）。

**第二条** 外部系统接入线路应遵循就近原则，线路接入地点由信息技术中心统一指定，外部线路与公司内部网络边界处必须部署防火墙设备、入侵防御和检测设备，按端口级设置点对点的访问控制。

**第三条** 外部系统接入点必须通过专用中间件接入公司信息系统，任何分支机构不得擅自通过分支机构的中间件与外部系统对接。

**第四条** 外部系统必须根据信息技术中心提供的统一外围接口标准与公司信息系统进行系统对接。

**第五条** 外部系统发出的交易指令必须仅在发起交易的投资者客户端与公司信息系统之间进行，期间任何其他主体不得对交易指令进行发起、接收、转发、修改、落地保存或截留，交易指令必须正确发送客户使用设备的IP地址、MAC地址以及能识别客户交易终端的特征代码(产品标识)等监管要求的关键信息。

**第六条** 外部接入信息系统是指机构或个人等通过互联网、专线、VPN、局域网等通讯方式通过公司交易系统标准接口接入，而不是直接使用我司购买、合作或者自行开发的交易系统或者客户端，从事期货交易的信息系统。

直连交易所的交易系统，必须经过交易所认证同时由期货公司购买、合作或者自行开发。客户自行开发或者客户购买的直连交易所系统禁止接入期货公司。

外部接入系统一般划分为两种类型，分别为：客户自开发的外部接入系统；由客户自行通过软件开发商采购的外部接入系统。

根据外部接入信息系统的功能可划分为具有资管（子账户）功能的外部接入系统和非资管功能的外部接入系统；具有程序化交易功能的外部接入系统和非程序化交易的外部接入系统。

**第七条** 本办法将根据外部信息系统的接入类型、功能划分分别进行管理，本办法适用于公司所有外部接入信息系统的情况。

**第二章 外部接入信息系统的上线管理**

**第八条** 信息技术中心负责对外部接入系统的验证测试、部署方案、运维管理、安全策略进行统一技术管理。

**第九条** 合规稽核部负责对外部接入系统管理办法、申请程序、资质条件及客户需签署的文件模板进行合规性审核，并依据监管规定和内控需要对公司外部接入信息系统管理工作进行定期或不定期稽核。

**第十条** 客户要求非直连交易所的外部接入系统接入公司信息系统之前必须向公司业务部门提交《外部接入信息系统申请表》(见附件1)，由业务部门与信息技术中心安排具体测试对接时间。

**第十一条** 客户接入必须确保公司能够收集到交易客户的以下相关信息与内容：互联网通讯协议地址（IP地址）、媒介访问控制地址（MAC地址）、能识别客户交易终端的特征代码(产品标识)以及其他监管要求的相关信息。

**第十二条** 客户需严格按照技术部提供的时间、系统和条件进行接入测试。客户需在所有相关的技术与业务内容测试通过之后，由业务部门初审客户提交的客户资料及测试报告后，向营销管理中心提交《外部接入信息系统技术测试报告》(见附件3)，外部接入系统在接入前必须由软件开发主体单位盖章或者软件使用者本人负责签署《软件承诺函》(见附件2)。

**第十三条** 营销管理中心对客户提交的材料进行审核，信息技术中心对该客户的外部接入信息系统的测试情况及整体接入状况进行全面评估。在公司领导审批通过之后，信息技术中心开放客户需求的技术通道和提供相关系统的接入信息，同时协助客户进行接入。

**第三章 具有资管功能的外部接入系统的管理细则**

**第十四条** 无论客户使用公司采购的资管系统还是自行采购的资管系统均必须纳入公司外部接入系统统一管理。

**第十五条** 个人客户不允许使用具有资管功能（子账户）的外部接入系统进行交易；

**第十六条** 针对具有资管功能（特别是子账户）功能的外部接入系统，开设子账户必须实名制，业务部门负责核实客户开设子账户主体的身份及资料，由客户服务部负责审核和开设。对于擅自开设子账户并且没有及时报备审核的，客户服务部应立即终止该期货账号的交易。

**第十七条** 公司合规稽核部有权随时对客户使用的资管系统进行核查，核查项目主要包括：子账户交易情况、子账户开户身份核查、子账户交易行为及登录信息核查等

**第十八条** 信息技术中心应指定专人定期对资管系统的委托交易数据、日志进行备份，数据备份的介质及方式严格按照公司《数据备份及介质管理制度》执行。

**第四章 具有程序化交易功能的外部接入系统的管理细则**

**第十九条** 如果客户使用程序化交易，必须进行程序化交易的报备申请，经业务部门主动提醒客户若使用程序化交易需主动报备，并提示程序化交易的交易风险，签署《软件承诺函》(见附件2)。

**第二十条** 程序化交易终端接入前必须经过信息技术部的验证测试，未经报备和验证测试的特殊程序化交易终端严禁接入公司交易系统。

**第二十一条** 客户出现交易异常情况，客户服务部对相关交易账户关闭交易权限的同时，应在第一时间通过录音电话或客户预留手机短信通知客户。 并通知信息技术中心关闭相应的接入通道。

**第二十二条** 业务部门负责做好使用外部信息系统接入的投资者的尽职调查工作，对所属业务部门的投资者做到充分了解，配合相关部门共同做好客户风险把控工作。

**第二十三条** 本办法自发文后正式执行。

天风期货股份有限公司

2018.5月

**附件一、外部信息系统接入申请表**

|  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- |
| 非自主开发软件填写部分 | | | | | |
| 厂商联系人 |  | 厂商联系方式 | |  | |
| 厂商营业执照复印件 |  | | | | |
| 自主开发软件填写部分 | | | | | |
| 开发人员姓名 |  | 开发人员联系方式 | |  | |
| 公共填写部分 | | | | | |
| 客户资金账户 |  | 客户姓名 | | |  |
| 系统产品标识 |  | 软件名称  及软件版本 | | |  |
| 在行业内是否有上线使用案例 | □是  □否 | | | | |
| 如有请填写期货公司名称 |  | | | | |
| 期货行业市场使用占有率 |  | | | | |
| 系统接入方式： | □互联网方式接入  □专线方式接入  □VPN方式接入  □其他方式：\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_ | | | | |
| 系统性质 | □直连交易所（外接会员API）  □非直连交易所（不外接会员API） | | | | |
| 直连交易所是否通过交易所认证 | □是  □否  □非直连 | | | | |
| 是否具有子账户管理功能 | □是  □否 | | | | |
| 是否具有程序化交易功能 | □是  □否 | | | | |
| 接入我公司软件/系统名称（注明版本要求） | □CTP □飞马 □易盛 □CTP MINI2  □飞创 □其他：\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_ | | | | |
| 交易模式 | 日内高频交易：  □人工下单□程序化下单 □人工下单+程序化下单  日内非高频交易：  □人工下单□程序化下单 □人工下单+程序化下单  □隔夜交易□组合交易  □其他类型：\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_ | | | | |
| 软件基本功能 | □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：\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_ | | | | |
| 程序化交易功能填写（非程序化不用填写） | | | | | |
| 程序化交易的交易编码信息 | 中金 | | 上期 | | |
| 大连 | | 郑州 | | |
| 能源 | |  | | |
| 程序化交易策略类型及简要说明 |  | | | | |
| 程序化交易的资金来源 |  | | | | |
| 程序化交易者的资产规模 |  | | | | |
| 程序化交易系统技术配置参数 |  | | | | |
| 程序化交易服务器所在地址 |  | | | | |
| 程序化联络人及联系方式 |  | | | | |
| 交易席位 |  | | | | |
| 合规操作说明 |  | | | | |
| 其他情况说明 |  | | | | |
| 客户负责人签字或盖章：\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_ 填报日期： 年 月 日 | | | | | |

**附件二、软件承诺函**

天风期货股份有限公司：

本人/本单位 （资金账号： ）自愿申请开通/接入 交易软件使用权限，预计下设 个主账户， 个子账户； 系新增账户权限的实际控制人。

本人/本单位已知悉并了解此系统/软件系客户自主选择使用的交易软件。本人/本单位已经了解，天风期货股份有限公司（以下简称“天风期货”）推荐并提供的交易软件为CTP期货网上交易系统连接公司主席交易系统，天风期货不推荐本人使用其他软件或连接其他次席进行期货交易。

本人/本单位确认已充分了解以下列明的风险提示：

一、二席接入系统风险揭示：

接入二席交易系统除可能发生《期货交易风险说明书》所列示的风险之外，可能因公司、其他合作方或相关电信部门的互联网软硬件设备故障或失灵、或人为操作疏忽而全部或部分中断、延迟、遗漏、产生误导或造成资料传输或储存上的错误，且交易期间遇到重大故障时，公司优先保障主席系统正常交易，若二席系统短时间不可修复，应急方案默认采用二席用户切回主席，交易时间应急切换可能产生钱仓不同步的风险。

二、资产管理系统软件风险揭示：

由于该软件系统自身的复杂性，无法保证软件完全没有错误。天风期货不提供任何明确的或暗示的担保、保证或条件，用户须自行承担使用该软件/服务的风险。该软件不保证软件不间断或无误差的运行，也不对通过软件/服务获得的任何结果作保证。对于因使用或无法使用本软件引起直接或间接的任何收益损失、利润或数据损失，或对于直接、间接、特殊的、偶然的、或间接产生的、使用或无法使用该软件进行交易和投资造成的盈亏、直接或间接引起的赔偿、损失、债务或是任何交易中止等均不承担赔偿责任。天风期货保留可以调整软件功能权利，根据每月对本软件的使用情况，天风期货有保留或可执行暂时终止使用本软件的权利。

三、外部接入系统（程序化接入）系统软件风险揭示

外部接入系统（程序化接入）系统软件除可能发生《期货交易风险说明书》所列示的风险之外，程序化软件可能因公司、其他合作方或相关电信部门的互联网软硬件设备故障或失灵、或人为操作疏忽、或程序化软件本身错误造成故障而全部或部分中断、延迟、遗漏、产生误导或造成资料传输或储存上的错误，可能遭第三人侵入系统篡改或伪造变造资料等引致风险。

以上接入方式均可能发生上述风险提示并未涵盖的风险。

本人/本单位清楚知悉上述交易软件风险揭示部分的相关内容，故本人/本单位自愿承诺：

1、 开通此软件/系统，仅作为本人/本单位交易通道使用。

2、 不利用此通道做配资、融资、代客理财业务。

3、 不利用该系统为违法证券期货业务活动提供账户开立、交易通道、投资者介绍等服务或便利。

4、 不利用该系统违规使用信息系统外部接入开展交易，为违法证券期货业务活动提供系统对接或投资交易指令转发服务。

5、 不利用该系统设立伞型资产管理计划，子伞委托人（或其关联方）分别实施投资决策，共用同一资产管理计划的期货账户。

6、 使用过程中，如发生操作不当、通讯线路故障、计算机系统故障、数据传输故障、网络故障等原因而造成的风险，全部经济损失由本人/本单位承担。

7、 本人/本单位同意自行承担使用第三方交易软件的所有风险及因该等风险可能造成的任何损害，以及自愿承担可能产生的额外费用。

8、 本人/本单位同意，天风期货对提供的第三方交易软件的安全、无误及不中断不承担任何明示或默示的保证责任。天风期货不就其准确性作出保证，并不就该软件造成的数据之任何错误或遗漏承担责任（包括任何第三者责任）。

9、 本人/本单位自行承担该软件使用过程中的相关风险或损失，包括但不限于使用该软件所实施的下设子账户、分账户的交易行为及资金调配行为、软件系统升级及使用不当而引发系统故障而导致的损失、因天风期货泄露密码导致其他人未经授权使用或尝试使用可能遭受的任何损失等。

10、 本人/本单位使用该软件所从事的交易均符合期货行业的监管规定，资金来源均为合法自有资金，绝不使用该软件从事配资业务及其他任何违法违规或涉嫌违法违规的用途，不使用接入软件及接口进行配资业务，不为非法期货交易行为提供便利。否则天风期货有权随时终止本人/本单位该软件账户使用权限，由此产生的一切法律责任及经济损失均由本公司自行承担。

11、 若日后监管机构对该软件新增账户使用权限行为进行规范清理，本人/本单位将严格按照监管要求配合天风期货进行相关处理，由此产生的一切法律责任及经济损失均由本人/本单位自行承担。

12、 开展系统对接前，如实向天风期货提供本人/本单位身份信息、用于程序化交易的交易编码信息、程序化交易策略类型及简要说明、程序化交易的资金来源类型、程序化交易者的资产规模、程序化交易系统技术配置参数、程序化交易系统服务器所在地址、程序化交易系统的开发主体及软件版本以及联络人及联系方式等天风期货要求提供的信息，确保内容属实，并接受天风期货的业务审查和风险评估。

13、 不出借、不转让本人/本单位的接入系统给任何第三方使用。本人/本单位承诺，符合账户实名制要求，合规使用本人/本单位自身账户，未经许可不在本人/本单位账户下设子账户、分账户、虚拟账户或将本人/本单位账户出借他人，不从事违法期货业务活动或者为违法期货业务活动提供交易便利。资产管理系统开设子账户、分账户、虚拟账户均需向天风期货申请。本人/本单位承诺，除证监会另有规定外，本人/本单位只使用自身账户从事程序化交易。

14、 本人/本单位的外部接入程序（程序化交易）不违反我国期货交易管理制度、我国反洗钱制度及相关交易所的交易规则,并按交易所要求备案。

15、 本人/本单位已知晓上述约定可能带来的风险、损失、民事责任和刑事责任，经过慎重考虑，本人/本单位系统申请接入天风期货系统，若本人/本单位违反以上承诺或其他期货监管规定，天风期货有权立即停止本人/本单位的系统接入并拒绝我方相关委托，并对我方追究相关责任，由此造成的一切后果由本人/本单位自行承担。

16、 本人/本单位已知晓本承诺函的揭示事项仅为列举性质，未能详尽列明特殊系统接入所面临的全部风险和可能导致我方资产损失的所有因素。

17、 本人/本单位在本承诺函上签字或机构盖章，表明我方已经理解并愿意自行承担使用以上交易软件的所有风险及因上述风险可能造成的任何损害。

客户签字：

（机构加盖公章）

年 月 日

**附件三、外部接入信息系统测试报告**

外部系统名称： 测试周期： 日

|  |  |  |
| --- | --- | --- |
| 客户号 |  | |
| 外接信息系统测试项目 | 是否正常 | 备注 |
| 接入我公司系统 | □ CTP □飞马 □易盛 □飞创 □其他系统：\_\_\_\_\_\_\_\_\_ |  |
| 是否为直连交易所系统 | □ 是  □ 否 |  |
| 登录验证测试 | □ 正常  □ 异常 |  |
| 交易功能验证测试 | □ 正常  □ 异常 |  |
| 风控功能验证测试 | □ 正常  □ 异常 |  |
| 委托单在主系统是否有系统认证标识 | □ 是  □ 否 |  |
| 系统认证标识为： |  |  |
| 其他情况说明 |  |  |