



广州期货交易所行情授权申请指引 (深度行情)

为满足市场参与者对商品期货信息数据需求，保障投资者公开、公平、公正参与广州期货交易所（以下简称“广期所”）上市品种交易，广期所向全市场提供信息数据产品服务。为便于各类机构申请经营广期所深度行情数据产品，特编写以下申请指引。

一、深度行情简介

深度行情，又称 Level-2 行情，广期所深度行情系统指广州期货交易所编辑的并在其所组织的集中交易市场中产生的、具有特定格式和结构关系的即时或定时行情增值数据信息，其内容包括基本最优行情、套利最优行情、五档深度委托行情、最优价位前十笔委托量、委托统计行情、分价成交量、实时结算价等（详细字段内容参见《广州期货交易所深度行情数据内容明细表》）。深度行情采取行情快照方式对交易数据进行切片采样，采样频率为 250 毫秒/次，即行情发送频率为 250 毫秒/次。

二、申请指引

发布深度行情的信息商均需与广期所签订授权许可协议，获得许可后方可对外进行服务。

（一）申请条件

任何合法成立的信息经营单位，符合以下全部条件，可以提出申请：

1. 具有固定的营业场所。
2. 持有上海期货交易所、郑州商品交易所、大连商品交易所、中国金融期货交易所、广州期货交易所中任意一家

Level-1 行情数据或 Level-2 行情数据授权资质 1 年以上。

3. 营业执照经营范围包含行情相关的信息经营内容（从事技术开发或提供计算机软件开发服务，或提供信息咨询服务等）。

4. 持有目前信息经营所需的全部相关资质和合法许可等。

5. 注册资金 500 万人民币以上（含），财务状况良好，技术实力可靠并具备为市场提供可靠服务的能力。

6. 自身、母公司或控股股东、子公司及控股公司、关联公司近三年内无非法或不良经营记录。

7. 经会计师事务所审计过的公司最近两年财务报表（含三大会计报表）。

8. 有能力自建用户档案管理系统、用户使用监控系统和计费管理系统，便于配合核查用户数据、用户缴费等情况，并指派专人管理及具体联系人。

9. 符合相关技术要求。

具备上述条件的单位可按以下流程向广期所提出申请，并逐一办理相关手续。

（二）申请流程

1. 申请方提交申请材料。

具体如下：

（1）《广州期货交易所行情信息服务商资质认证申请表》。

（2）《申请方基本情况表》。

(3)《广州期货交易所深度行情信息服务商认证技术方案书》：主要描述申请单位的技术研发能力和技术支撑系统，用以说明申请方有足够的技术能力做好深度行情展示，同时保护好交易所信息安全。

(4)《广州期货交易所深度行情信息服务商认证商业方案书》：主要包括公司背景资料介绍、产品设计和定位、营销策略、团队建设等内容的描述，用以说明申请方有足够能力做好信息行情的市场推广和用户服务工作。

(5) 公司营业执照复印件。

(6)最近两年财务报表：经会计师事务所审计过的公司最近两年财务报表（含三大会计报表）。

(7) 公司外部组织关系说明：与控股公司、子公司的组织结构关系，以及所有权百分比情况，并说明是否这些公司是交易所市场或证券、期货信息经营市场参与者。如无母公司和子公司，也请书面说明。

(8) 其他补充材料：申请方认为有必要提供的，或广期所认为申请方有必要提供的其它补充资料或证明材料，以及需要得到我方协助的要求等。

材料提交联系人：赵伟

电话：020-28183869

邮箱：zhaowei@gfex.com.cn

2. 申请审批

广期所除对申请材料进行审核外，还会根据实际情况对申请方的以下情况进行核实，包括但不限于：

(1) 申请方办公场地。

(2) 申请方人员配置。

(3) 申请方未来接入广期所行情的信息系统。

3. 通过审批后，双方签署行情经营许可协议。

4. 申请方缴纳相关费用。

5. 申请方提交《信息商新建链路接入指引》中的申请表。

由于技术准备周期较长，在申请方缴费之前，广期所可提供相关答疑和链路接入支持。

6. 广期所将完成合同签署及缴费的申请方名称在广期所官方网站公示。

(三) 经营要求

1. 按许可的用途、范围在许可有效期内经营基本行情、深度行情，不得将授权许可进行出售或转让。

2. 未经广期所书面许可，不得将全部或部分广期所行情信息传播到许可证指定以外的任何单位或个人及用于许可证指定以外的任何地方和用途。

3. 不得将全部或部分广期所行情信息的传播用于非法目的，或者主动提供给第三方用于非法目的。

4. 未经广期所书面许可，不得使用广期所的名称与标识（包括但不限于文字、图案或记号等）。

5. 不得采取冒用广期所名义、夸大产品功能、贬损竞争对手等手段进行虚假、误导性宣传。

6. 根据授权协议规定，申请方需接受并配合广期所不定期审计工作。

上述内容仅为事前告知，具体经营要求以许可单位和广期所签订的信息经营许可协议为准。

（四）拒绝申请说明

1. 申请材料中存在虚假信息，未来 1 年内申请将被视为无效申请。

2. 申请方曾为广期所授权信息商的，但由于违反审计条例而被取消授权信息商资格的，于取消资格之日起的 2 年内不得再次申请授权。

（五）材料更新说明

随着申请方业务发展，产品更新迭代，申请时所提交的《广州期货交易所深度行情信息服务商认证技术方案书》、《广州期货交易所深度行情信息服务商认证商业方案书》需要及时更新，以合同生效期为有效时间点，每两年更新上述文件，由申请方通知广期所。如在审计中发现申请方未及时更新相应材料，将根据实际情况责令整改。

上述内容解释权和调整权归广期所所有。