

程序化交易委托协议文本（必备条款）

（征求意见稿）

本协议于 年 月 日由下列双方签署。

甲方（交易者）：

乙方（期货公司）：

根据《中华人民共和国民法典》《中华人民共和国期货和衍生品法》《期货市场程序化交易管理规定（试行）》（以下简称《管理规定》）等有关规定，甲乙双方在签署《期货经纪合同》的基础上，经友好协商，就甲方从事程序化交易委托乙方的有关事宜达成如下协议：

第一章 释义

第一条 本协议所称程序化交易，是指通过计算机程序自动生成或者下达交易指令在期货交易所进行期货交易的行为。

本协议所称高频交易是指甲方交易行为具备以下一项或者多项特征的程序化交易：

- （一）短时间内报单、撤单的笔数、频率较高；
- （二）日内报单、撤单的笔数较高；
- （三）中国证监会认定的其他特征。

高频交易具体标准按照期货交易所规定执行。

第二章 程序化交易报告

第二条 甲方应当按照《管理规定》、期货交易所规定和本协议约定及时向乙方履行报告义务，确保报告的信息真实、准确、完整。

第三条 甲方从事程序化交易前，应当向乙方报告有关信息，在收到乙方书面确认后，方可从事程序化交易。甲方应当报告的信息包括：

（一）账户基本信息，包括交易者名称、交易编码、委托的期货公司、产品管理人等；

（二）交易信息和交易软件信息，包括交易指令执行方式和交易软件名称、基本功能、开发主体等；

（三）期货交易所要求的其他信息。

甲方使用乙方提供的交易软件从事程序化交易的，交易软件信息应当由乙方提供，乙方应当确保所提供的信息真实、准确、完整。

第四条 乙方应当就期货交易所对本协议第三条的反馈结果向甲方进行书面确认。

第五条 甲方从事程序化交易符合高频交易特征的，除本协议第三条约定信息外，还应当按照期货交易所要求向乙方报告交易策略类型及主要内容、最高报撤单频率、单日最高报撤单笔数、服务器所在地、技术系统测试报告、应急预案、风险控制措施等信息。

第六条 甲方已报告信息发生重大变更的，应当在变更

发生后下一个自然月的前5个交易日内向乙方进行变更报告。

甲方已报告信息存在下列情形之一的，属于重大变更：

（一）交易者名称、产品管理人发生变更；

（二）交易指令执行方式、交易软件名称、开发主体、基本功能发生变更；

（三）停止进行程序化交易；

（四）期货交易所认定的其他重大变更情形。

甲方使用乙方提供的交易软件从事程序化交易的，交易软件名称、开发主体、基本功能发生变更时，变更的有关信息应当由乙方提供，乙方应当确保所提供信息的真实、准确、完整。

第七条 甲方从事程序化交易符合高频交易特征的，除本协议第六条约定情形外，甲方已报告的交易策略类型、最高报撤单频率、单日最高报撤单笔数发生变更时，还应当在变更发生后下一个自然月的前5个交易日内向乙方进行变更报告。

第八条 乙方有权对甲方从事程序化交易报告的信息进行检查，包括但不限于对甲方身份进行穿透核查，对账户交易信息和交易软件信息等进行核查，甲方应当配合。

第九条 乙方应当对甲方从事程序化交易报告的信息承担保密义务，不得非法买卖、提供、公开或者以其他不正当手段使用甲方从事程序化交易报告的信息，不得泄露所知悉的商业秘密等。

第三章 系统接入

第十条 甲方从事程序化交易需要乙方提供交易信息系统外部接入服务的，甲乙双方应当遵守中国证监会有关规定和期货交易所、中国期货业协会业务规则。

第十一条 甲方应当确保用于程序化交易的技术系统符合期货交易所规定和乙方要求，具备有效的异常监测、阈值管理、错误防范、应急处置、日志记录等功能，并积极采取风险控制措施，防范网络和信息安全等风险。

第十二条 乙方应当确保使用的交易信息系统符合中国证监会和期货交易所规定，具备有效的认证管理、验资验仓、权限控制、异常监测、阈值管理、错误处理、应急处置、日志记录等功能。

第十三条 甲方用于程序化交易的技术系统在接入乙方交易信息系统前，乙方应当按照《管理规定》及期货交易所规定对甲方技术系统进行测试，甲方应当配合。

第十四条 甲方用于程序化交易的技术系统发生网络和信息安全等风险，可能导致风险传导的，乙方有权按照期货交易所、中国期货业协会业务规则采取暂停系统接入等措施。

第四章 交易行为管理

第十五条 甲方应当遵守有关法律法规、监管规定、期货交易所和中国期货业协会业务规则及本协议约定，依法合

规从事程序化交易，遵循公平原则，不得影响期货交易所系统安全和正常交易秩序，不得侵害其他交易者的合法权益。

甲方为法人或者非法人组织的，应当建立并有效执行程序化交易内部控制、风险管理、合规管理等制度。甲方负责合规和风险管理的责任人员应当对程序化交易的合法合规性、风险管理有效性进行监督和检查，并不得兼任与前述职责存在利益冲突的职务。

第十六条 乙方有权监控甲方程序化交易行为，按照期货交易所规定对甲方程序化交易委托指令进行审核，识别、管理甲方异常交易行为，并按照期货交易所规定采取相关措施。

第十七条 甲方存在下列行为的，乙方有权拒绝继续接受甲方开仓委托及按照期货交易所规定采取相关措施：

（一）甲方拒不履行或者未真实、准确、完整、及时履行报告或者变更报告义务，经乙方督促仍不及时改正；

（二）甲方拒绝接受乙方有关程序化交易的核查；

（三）甲方实际用于程序化交易的技术系统与乙方测试的系统不一致；

（四）甲方利用系统对接非法经营期货业务，招揽交易者或者处理第三方交易指令，转让、出借自身技术系统或者为第三方提供系统外部接入；

（五）甲方程序化交易可能影响期货交易所系统安全或者正常交易秩序；

（六）甲方程序化交易可能涉及操纵市场、内幕交易等

违法违规行为；

（七）双方约定的其他事项。

第十八条 甲方从事程序化交易，因不可抗力、意外事件、重大技术故障、重大人为差错等突发事件，可能引发期货价格或者市场重大异常波动的，应当立即采取暂停交易、撤销委托等措施，并及时向乙方报告。

乙方发现甲方出现前款情形的，有权立即采取暂停接受甲方委托、撤销相关报单等措施。

第五章 违约责任及协议的终止

第十九条 甲乙双方因任何一方违反本协议，而给对方造成实际损失的，应当承担赔偿责任。一方严重违反本协议，导致本协议不能履行的，非违约方有权解除协议并要求赔偿，本协议自非违约方发出书面解约通知之日起解除。

第二十条 因出现不能预见、不能避免且不能克服的不可抗力情形，或者因出现无法控制和不可预测的系统故障、设备故障、通讯故障、电力故障等异常事故，或者因本协议生效后新颁布、实施或者修改的法律、法规、规章、规则或者政策等因素，导致协议任何一方不能及时或者完全履行本协议的，其相应责任应当予以免除。

遭受不可抗力、异常事故或者知悉政策法律变化的一方或者双方应当在遭受不可抗力、异常事故或者知悉政策法律变化后的【 】日内书面通知另一方，并提供相应证明，双

方应当积极协调善后事宜。

第二十一条 本协议经甲乙双方书面协商一致，可解除协议。甲乙双方因丧失业务资格或者依法不能从事相关业务的，本协议自动终止。甲乙双方签署的《期货经纪合同》终止或者按照有关约定和有关法律法规的规定提前解除时，本协议自动终止。

第六章 其他约定

第二十二条 乙方按照本协议约定采取拒绝接受甲方委托、撤销甲方报单、暂停系统接入等措施的，相关的任何后果、风险和损失由甲方自行承担。

第二十三条 有关本协议的签署、效力和争议解决等均适用中华人民共和国法律、法规及其他有关规章、规则。

第二十四条 本协议签署后，若有关法律、法规、规章、规则修订，本协议与之不相适应的内容及条款自动失效，有关内容及条款按照新修订的法律、法规、规章、规则办理，但本协议其他内容和条款继续有效。

第二十五条 经甲乙双方签字或者盖章，且甲乙双方签署的《期货经纪合同》已生效时，本协议生效。本协议一式两份，甲乙双方各执一份，每份具有同等的法律效力。

第二十六条 本协议执行中发生的争议，甲乙双方可自行协商解决或者向期货纠纷调解机构申请调解，若协商或者调解不成，双方同意按以下第【 】种方式解决：

1. 提交【 】仲裁委员会仲裁；

2. 向【 】人民法院提起诉讼。

第二十七条 本协议未作约定的，按照双方《期货经纪合同》的约定执行。

甲方（签字/盖章）：

乙方（盖章）：

签署日期： 年 月 日 签署日期： 年 月 日