

# 程序化交易委托协议

甲方（期货公司）：金瑞期货股份有限公司

乙方（交易者）：\_\_\_\_\_

期货资金账号：\_\_\_\_\_

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，就乙方从事程序化交易委托甲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乙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。

**第二条** 书面方式包括但不限于：含纸质合同书、纸质

信件和数据电文（包括电报、电传、短信、传真、电子数据交换和电子邮件）等可以有形地表现所载内容的形式。

## **第二章 程序化交易报告**

**第三条** 乙方应当按照《管理规定》、期货交易所规定和本协议约定及时向甲方履行报告义务，确保报告的信息真实、准确、完整。

**第四条** 乙方从事程序化交易前，应当向甲方报告有关信息，甲方核查无误后应当按照期货交易所规定向其报告，甲方在收到期货交易所反馈后以书面形式向乙方确认。乙方收到甲方确认后，方可从事程序化交易。乙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。

乙方使用甲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甲方提供，甲方应当确保所提供的信息真实、准确、完整。

**第五条** 乙方被期货交易所认定为高频交易者的，除须履行本协议第四条的报告义务外，还应当向甲方报告交易策

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、应急方案、风险控制措施等信息。

**第六条** 乙方已报告信息发生重大变更的，应当在变更发生后【5】个交易日内向甲方进行变更报告。乙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、基本功能、开发主体发生变更；
- （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。

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

**第七条** 乙方被期货交易所认定为高频交易者的，除须履行本协议第六条的报告义务外，乙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【5】个交易日内向甲方进行变更报告。

**第八条** 甲方有权定期或者不定期对乙方从事程序化交易报告的信息进行核查，包括但不限于对乙方身份进行核查，对账户交易信息和交易软件信息等进行核查，乙方应当配合。

**第九条** 甲方应当对乙方从事程序化交易报告的信息和

配合核查提供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乙方报告和提供的信息，不得泄露所知悉的商业秘密等。

### **第三章 系统接入**

**第十条** 乙方从事程序化交易需要甲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** 乙方应当确保用于程序化交易的技术系统符合中国证监会、期货交易所、中国期货业协会规定和甲方要求，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** 甲方应当确保使用的交易信息系统符合中国证监会、期货交易所和中国期货业协会规定，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** 乙方用于程序化交易的技术系统在接入甲方交易信息系统前，甲方应当自行或者委托第三方机构对乙方技术系统进行测试，乙方应当配合。

**第十四条** 乙方不得利用系统对接从事配资、非法经营期货业务等违法违规活动，不得招揽交易者或者处理第三方交易指令，不得转让、出借自身技术系统或者为第三方提供

系统外部接入。

**第十五条** 乙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，可能存在风险传导、影响期货交易所系统安全或者正常交易秩序、侵害其他交易者的合法权益等情形的，甲方有权采取暂停系统接入等措施。

## **第四章 交易行为管理**

**第十六条** 乙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。

乙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。乙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，并符合《管理规定》的任职要求。

**第十七条** 甲方有权监控乙方程序化交易行为，按照期货交易所规定对乙方程序化交易委托指令进行审核，识别、管理乙方异常交易行为，并配合期货交易所采取相关措施。

**第十八条** 乙方存在下列行为的，甲方有权拒绝继续接受乙方开仓委托及按照中国证监会、期货交易所和中国期货业协会规定采取相关措施：

（一）乙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，经甲方督促仍不及时改正；

（二）乙方拒绝接受或者不配合甲方有关程序化交易的核查；

（三）乙方实际用于程序化交易的技术系统与甲方测试的系统不一致；

（四）乙方利用系统对接从事配资、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）乙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）乙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）法律法规、中国证监会有关规定、期货交易所和中国期货业协会业务规则等规定的其他情形；

（八）双方约定的其他事项。

**第十九条** 乙方从事程序化交易，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，并及时向甲方报告。

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

## **第五章 违约责任及协议的终止**

**第二十条** 甲乙双方任何一方违反本协议，应当承担相

应的法律责任。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的书面形式解约通知到达另一方之日起解除。

**第二十一条** 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【5】日内以书面形式通知另一方，并提供相应证明，双方应当积极协调善后事宜。

**第二十二条** 本协议经甲乙双方协商一致，可以解除。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**

**第二十三条** 甲方按照本协议约定采取拒绝接受乙方委托、撤销乙方报单、暂停系统接入等措施的，甲方不承担相关的任何后果、风险和损失。

乙方知晓并遵守期货交易所有关异常交易、程序化交易、收取申报费、质押配比、实际控制关系账户的规定，并承担由此产生的一切后果。

乙方知晓交易所实行报撤单收费、交易限额等制度，并适时调整报撤单收费标准、交易限额标准，以及对高频交易手续费实施差异化等。具体标准以有关监管、交易所规定、规则为准。

乙方知晓接入外部系统并将分/子账户提供给不同主体使用的行为，违反《期货和衍生品法》第18条规定，涉嫌非法经营期货业务，还可能构成刑事犯罪，通过分/子账户发生的全部交易金额将被认定为非法所得予以没收。根据《刑法》第225条规定，有上述行为的，可能会被判处五年以下有期徒刑或者拘役，并处或单处违法所得一倍以上五倍以下罚金；情节特别严重的，处以五年以上有期徒刑并处违法所得一倍以上五倍以下罚金或者没收财产。

**第二十四条** 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。

**第二十五条** 本协议签署后，若有关法律、法规、规章、规则发生变化，甲方有权依照上述变化直接变更本协议与此相关部分的条款，变更或者补充条款优先适用。

根据上述情况的变化，甲方对本协议有关条款进行的变更或者补充，以书面形式通知乙方及在甲方营业场所、网站公告等方式向乙方发出，变更或者补充协议于该协议发出【3】日后生效。变更与补充协议生效之前，乙方有权与甲方进行



协商。

**第二十六条** 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。

本协议执行中发生的争议，甲乙双方可以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，双方同意向甲方所在地有管辖权的人民法院起诉。

**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（盖章）：

乙方（签字/盖章）：

签署日期：      年    月    日      签署日期：      年    月    日