

# 广州期货交易所程序化交易管理业务指南

根据《广州期货交易所异常交易行为管理办法》，广州期货交易所（以下简称交易所）实行程序化交易行为报备制度。非期货公司会员、境外特殊非经纪参与者或客户采取程序化交易方式下达交易指令的，应当主动向交易所报备程序化交易相关信息。结算后收到程序化客户报备通知的非期货公司会员、境外特殊非经纪参与者应当及时报备程序化交易相关信息；收到程序化客户报备通知的期货公司会员，应当及时联系客户，并报备程序化交易相关信息。具体报送内容和流程说明如下。

## 一、程序化交易报备途径和内容

### （一）客户

采取程序化交易方式下达交易指令的或者收到交易所报备通知的客户，应当通过委托的期货公司会员向交易所报备。报备信息包括以下内容：会员名称、会员号、客户名称、交易编码、交易地点、客户联系电话、交易席位、交易模式、软件名称、软件提供者、系统接入方式、交易开始日期、软件基本功能、交易策略说明、合规操作说明，以及会员单位的联系人和联系电话。

### （二）非期货公司会员、境外特殊非经纪参与者

采取程序化交易方式下达交易指令的或者收到交易所报备通知的非期货公司会员、境外特殊非经纪参与者，应当

直接通过会员服务系统向交易所报备。报备信息包括以下内容：非期货公司会员或境外特殊非经纪参与者名称、交易编码、交易地点、交易席位、交易模式、软件名称、软件提供者、系统接入方式、交易开始日期、软件基本功能、交易策略说明、合规操作说明，以及联系人和联系电话。

非期货公司会员、境外特殊非经纪参与者和客户应当保证所提供的报备信息和其他材料的真实性、准确性和完整性。期货公司会员在收到交易所程序化交易报备通知后，应当及时通知相关客户，并对客户提交的相关材料进行初审。

交易所可以根据中国证监会的监管政策要求和市场运行状况，制定或调整程序化交易报备内容和管理方式。

## 二、程序化交易报备流程

会员、境外特殊非经纪参与者应通过会员服务系统进行程序化交易报备，具体流程如下所示。

### （一）程序化交易申报

1. 点击左侧菜单“程序化交易→增加电子报备记录”，打开页面如图 1-1 所示。填写相应的内容，其中星号项为必填项。填写完毕，点击【提交】。

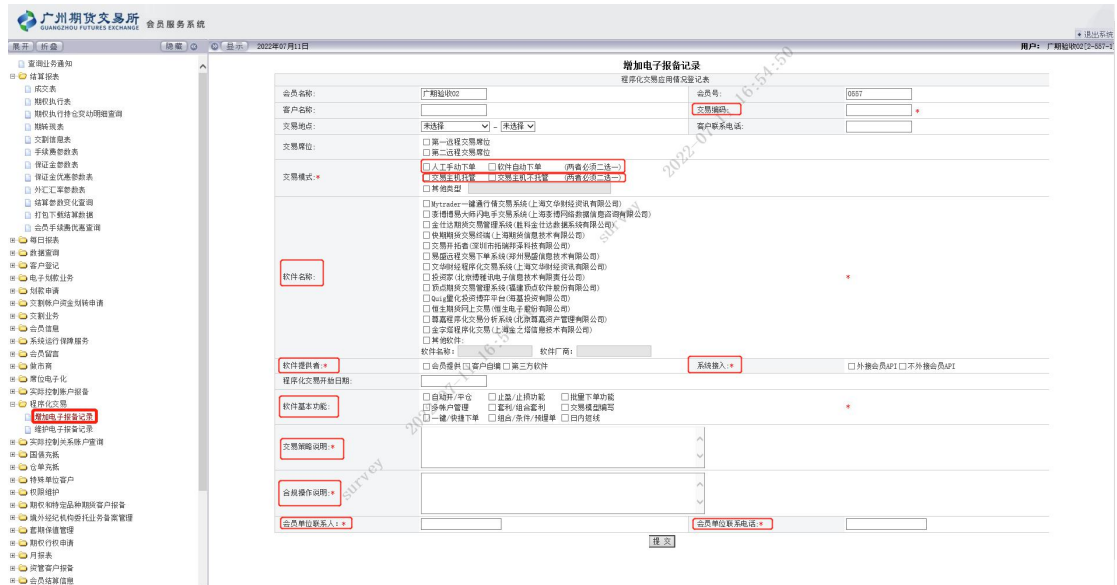


图 1-1

## (二) 程序化交易报备查询、修改与删除

1. 点击左侧菜单“程序化交易→维护电子报备记录”，打开页面如图 2-1 所示。



图 2-1

2. 填写“客户名称”或“交易编码”，选择“报备日期”、“可用状态”，点击【查询】按钮，进入如图 2-2 所示页面，可查看历史申报信息。



图 2-2

3. 点击对应记录的【详细】按钮，可查看报备信息，如图 2-3 所示。



图 2-3

4. 找到需要修改的报备记录，点击【修改】按钮，可对报备信息进行修改，点击【提交】按钮后生效。

5. 找到需要删除的报备记录，点击【删除】按钮，再点击“确定”按钮，如图 2-4 所示，该条记录将变为不可用状态。



图 2-4