

# 上海期货交易所文件

上期发〔2024〕115号

---

## 上海期货交易所关于发布程序化交易 报备工作说明的通知

各有关单位：

为规范程序化交易行为，维护市场公平交易秩序，保护交易者合法权益，根据《中华人民共和国期货和衍生品法》等法律、行政法规、部门规章、规范性文件，以及《上海期货交易所交易规则》等业务规则，现就有关程序化交易报备工作的说明通知如下：

一、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的行为。

二、上海期货交易所（以下简称本所）对程序化交易实施报备管理，各单位应当加强程序化交易行为的识别、管理，并按规定向本所报备。具体要求按照本所《关于做好程序化交易报备工作的通知》（上期交交易字〔2010〕250号）和《关于程序化报

备网上申报的通知》(上期办发〔2011〕143号)执行。

三、本所程序化交易报备标准为，符合“同一客户存在一个交易日内出现5次及以上1秒内下单5笔及以上(不分合约)”的程序化交易行为。本所将定期开展数据筛查，对符合报备标准而未报备的进行督促提醒，相关单位应当按照要求及时更新报备信息或报备，并对未更新报备信息或未报备的书面说明情况。程序化交易报备标准如有调整，本所将另行通知。

四、本所可以根据自律监管需要对程序化交易报备工作的开展情况进行现场或者非现场检查，各单位应当积极配合。

特此通知。

上海期货交易所

2024年4月12日

(联系人：戴光懿 021-68401501 张灵慧 021-68402809)

---

上海期货交易所

2024年4月12日印发

---

打字：金思怡

校对：戴光懿

共印1份