

关于未按交易所规定进行程序化交易报备的风险告知书

尊敬的客户：

根据中国金融期货交易所、郑州商品交易所、大连商品交易所、上海期货交易所、上海国际能源交易中心以及广州期货交易所发布的关于程序化交易报备事宜的通知和相关制度规定，如果交易者符合以下标准应该履行程序化交易报告义务：

1. 在1个交易日内出现10次（含）以上1秒钟内10笔（含）以上报撤单的，实际控制关系账户组的报撤单笔数按照单个客户执行。
2. 合约代码、买卖方向、委托数量、委托价格等交易指令核心要素以及交易指令的下达时间均由计算机自动决定的。
3. 使用自主研发或者其他定制程序化交易软件的。
4. 交易所认定的其他需要报告的情形。

交易者从事程序化交易应遵守“先报告、后交易”的要求，如存在未按规定报告的，金瑞期货股份有限公司（以下简称金瑞期货）将按照交易所的规定及期货经纪合同约定对违反期货交易所规则的交易者采取限制其期货账户全部或部分功能。

请您/贵司充分了解期货合约的相关业务规则，充分认识期货交易风险，知悉程序化交易的相关业务规则，请您/贵司签署外部接入协议、交易委托协议及交易所收取交易申报费的风险的告知书，按照金瑞期货的要求完成交易系统测试、程序化交易信息报告表及其他事项。

请您/贵司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，处五年以上有期徒刑并处所得一倍以上五倍以下罚金或者没收财产。

2025年10月9日前已经从事程序化交易相关活动且已在交易所进行过程序化交易报备的交易者，应当在2026年4月8日15:00分前完成以上程序化交易报备工作。

2025年10月9日之后如果交易者存在未进行程序化交易报备且符合履行程序化交易报告义务情形，交易者不得从事程序化交易，应立刻履行程序化交易报告义务。

如您/贵司未履行程序化交易报告义务或未在规定时间内完成报告，除交易所对您/贵司采取监管措施外，金瑞期货将限制您/贵司期货账户的全部或部分功能，包括但不限于关闭开仓交易权限。

本人/单位知晓金瑞期货股份有限公司对本人/本单位期货账户未履行程序化交易报告义务或未在规定时间内完成程序化交易报备情形时，将采取限制期货账户全部或部分功能，包括但不限于关闭开仓交易权限，并承担由此产生的一切后果。

客户签章：

年 月 日