

关于实际控制关系账户信息申报 及程序化交易报备的告知书

尊敬的客户：

根据《中华人民共和国期货和衍生品法》、《期货公司监督管理办法》、《期货市场实际控制关系账户管理办法》等法律法规要求，及中国期货市场监控中心和各交易所关于做好实际控制关系账户报备及程序化交易报备工作的通知要求，您如果与其他期货账户之间存在实际控制关系、通过计算机程序自动生成或者下达交易指令进行程序化交易，应按规定主动将有关信息进行申报并提交相关材料，由我司通过中国期货市场监控中心（以下简称“监控中心”）向交易所报备。现将有关事项告知如下：

一、关于实际控制关系账户信息申报的事项

（一）实际控制关系账户的认定标准

实际控制是指行为人（包括个人、单位）对他人（包括个人、单位）期货账户具有管理、使用、收益或者处分等权限，从而对他人交易决策拥有决定权的行为或事实。根据实质重于形式的原则，具有下列情形之一的，应当认定为行为人对他人期货账户的交易具有实际控制关系：

1、行为人作为他人的控股股东，即行为人的出资额占他人资本总额 50%以上或者其持有的股份占他人股本总额 50%以上的股东，出资额或者持有股份的比例虽然不足 50%，但依其出资额或者持有的股份所享有的表决权已足以对股东会、股东大会的决议产生重大影响的股东；

2、行为人作为他人的开户授权人、指定下单人、资金调拨人、结算单确认人或者其他形式的委托代理人；

3、行为人作为他人的法定代表人、主要合伙人、董事、监事、高级管理人员等，或者行为人与他人的法定代表人、主要合伙人、董事、监事、高级管理人员等一致的；

4、行为人与他人之间存在配偶关系；

5、行为人与他人之间存在父母、子女、兄弟姐妹等关系，且对他人期货账户的日常交易决策具有决定权或者重大影响；

6、行为人通过投资关系、协议、融资安排或者其他安排，能够对他人期货账户的

日常交易决策具有决定权或者重大影响；

7、行为人对两个或者多个他人期货账户的日常交易决策具有决定权或者重大影响；

8、行为人与他人交易行为具有一致性且存在一方向另一方提供期货交易资金的，或者行为人与他人交易行为具有一致性且双方交易终端信息一致的；

9、中国证监会规定或交易所认定的其他情形。

(二) 实际控制关系账户的报备工作要求

1、符合实际控制关系账户认定标准的客户应当在签署经纪合同后 10 个交易日内完成实际控制关系报备。实际控制关系的控制人和被控制人都应当主动通过我司填写《实际控制关系账户申报表》向期货交易所报备实控关系。

2、实际控制关系发生变更后，应当在 10 个交易日内主动通过我司向期货交易所报备变更情况。

3、监控中心以监测监控数据为基础，与期货交易所建立实际控制关系账户信息共享与协查机制，建立共享平台，对日常监控中发现具有疑似实际控制关系且尚未报备的账户，将通过我司或直接向客户进行书面询问。

如客户承认存在实际控制关系，应按照正常流程进行申报。

如客户否认存在实际控制关系，应提供书面说明，并签署《合规声明及承诺书》，如涉及到私募基金产品类账户，还应提供基金经理及 20%(含)以上份额持有人信息。期货交易所将对相关说明材料进行审核，对于事实清楚、理由充分、确不属于实际控制关系的，期货交易所将不按实际控制关系对相关账户进行管理；对于事实不清、理由不充分、不足以排除实际控制关系认定的，期货交易所将进行调查，经调查认为符合实际控制关系认定标准的，期货交易所所有权责令客户限期报备，客户拒不报备或未在规定时间内完成报备的，期货交易所所有权直接认定实际控制关系，并根据相关规定进行处理；若经调查暂无法认定是否符合实际控制关系认定标准的，期货交易所将相关账户列入重点监控名单。

4、对于不如实申报实际控制关系信息、隐瞒事实真相、故意回避等不配合报备工作的客户，公司将配合期货交易所及相关监管机构对相关客户采取相应措施。

5、关于实际控制关系账户的认定标准和报备工作要求如有变动，以监控中心或期货交易所最新通知和规定为准。

(三) 对实际控制关系账户的管理

1、对已认定的实际控制关系账户组视作同一客户，对一组实际控制关系账户的委

托量、撤单量、成交量以及持仓量等合并计算。

2、一组实际控制关系账户投机持仓合并计算后超过交易所对单个客户的投机持仓限额规定的，视作合并持仓超限异常交易行为。

3、一组实际控制关系账户的套利持仓量不得超过交易所确定的套利持仓额度，一组实际控制关系账户的套利持仓量和投机持仓量合计不得超过交易所确定的套利持仓额度。

4、一组实际控制关系账户的套期保值持仓量不得超过交易所确定的套期保值持仓额度，一组实际控制关系账户的套期保值持仓量和投机持仓量合计不得超过交易所确定的套期保值持仓额度。

5、一组实际控制关系账户之间发生成交的，按照自成交行为处理。

6、一组实际控制关系账户发生持仓超限行为的，若客户未在下一交易日交易所规定时间内自行调整完毕的，交易所将于下一交易日按有关规定执行强行平仓。

二、关于程序化交易报备的事项

（一）程序化交易的报备工作要求

1、程序化交易是指由计算机按照事先设定的具有行情分析、风险管理等功能的交易模型，自动下达交易信号或报单指令的交易方式。

2、客户使用程序化交易的，应当符合国务院期货监督管理机构的规定，并如实填写《程序化交易应用情况登记表》，通过我司向期货交易所报备，不得影响期货交易所系统安全或者正常交易秩序。

3、根据《中华人民共和国期货和衍生品法》规定，违反程序化交易报备规定，采取程序化交易影响期货交易所系统安全或者正常交易秩序的，将被责令改正，并处以五十万元以上五百万元以下的罚款。对直接负责的主管人员和其他直接责任人员给予警告，并处以十万元以上一百万元以下的罚款。

（二）程序化交易的风险提示

1、客户使用程序化交易系统/软件进行期货交易前，应知晓并接受该系统/软件的相关特性和局限性，对因使用该系统/软件可能导致的被期货交易所认定为异常交易行为、下达交易指令错误、获得成交结果失败等一切后果，均由客户自行承担；

2、由于无法控制和不可预测的原因，可能发生我司与期货交易所的远程数据专用通讯线路故障、或者我司交易系统故障、或者电力故障等情况，导致我司的交易系统无法正常运行甚至瘫痪，而期货交易所还在正常交易，由此造成的后果须由客户本人承担；

3、如果客户缺乏网上交易经验或客户使用的电脑设备及软件系统与我司的网上交易系统不相匹配，可能导致客户的交易失败或交易失误，由此造成的后果须由客户本人承担；

4、使用期货公司或者其他第三方开发的程序化交易软件，由于无法排除交易软件存在设计的缺陷或局限性，可能造成最终交易结果不符合预期，或者导致交易失败或交易失误，由此造成的后果须由客户本人承担；

5、因特网上发布的各种期货信息，可能出现错误或被恶意误导情况。

（三）程序化交易的注意事项

1、若您使用的交易软件非我司提供的，则还需满足监控中心看穿式监管认证要求，同时遵守我司外部接入和程序化接入管理要求，事先向我司提出申请，经审核通过后方可进行程序化交易；未经我司审核即自行开展程序化交易的，我司发现后将及时制止并如实上报期货交易所；

2、请在您的交易终端上使用正版软件，安装并定期升级可信赖的杀毒软件和网络防火墙，定期下载和安装补丁程序；

3、如您的电脑系统、网络通讯或网上交易相关软件出现异常情况，请暂停网上委托，转用其他委托交易手段，并及时与我司联系；

4、请勿在网吧等公共电脑上进行网上交易；

5、请在期货公司网站下载相关行情和交易软件，我司的网站为 www.rdqh.com。

以上告知书的各项内容，瑞达期货股份有限公司已向本人/单位告知，本人/单位已知晓和完全理解，并承诺将遵守告知书的各项内容。

客户签字：

（机构加盖公章）

法定代表人或被授权人签字：

签署日期： 年 月 日