

关于交易所收取交易申报费的风险告知书

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申报费事宜的通知，如果客户（做市商除外）当日在交易所指定合约上信息量超过各交易所规定的标准，各交易所将在每日结算时（以交易所申报费收取规则进行收取）按合约、按日收取申报费（其中中国金融期货交易所股指期货合约根据客户申报数量收取申报费，每笔申报费收取固定标准，申报是指买入、卖出及撤销委托）。具体如下：

1. 收取申报费的合约、收费标准及信息费认定标准等以各交易所最新通知为准。

2. 交易所合约申报费= Σ （非期货公司会员或者客户当日在合约上各档位信息量*该档位收费标准），其中中国金融期货交易所股指期货合约申报费=客户当日在合约上的申报数量*每笔申报数量收取标准，具体以各交易所最新通知为准。

3. 信息量=下单、撤单、询价等交易指令笔数之和。上述信息量包括附加立即全部成交否则自动撤销指令（FOK）和立即成交剩余指令自动撤销（FAK）属性的指令、市价指令产生的报单和撤单笔数。

4. 报单成交比（OTR）=信息量/有成交下单笔数-1（当有成交下单笔数为0时，上海期货交易所、上海国际能源交易中心以及中国金融期货交易所国债期货合约视为当日该合约的有成交下单笔数为1，郑州商品交易所、大连商品交易所以及广州期货交易所视为OTR大于2）。不同报单成交比，各档位信息量收费不同。

5. 同一客户在不同期货公司处开户的，或者具有实际控制关系的客户或者非期货公司会员，交易所对其全部交易编码的信息量笔数和成交的报单笔数合并计算，并根据该客户在不同期货公司产生的信息量比例，确定其在相关期货公司应付的申报费。

6. 申报费的收取金额不设上限，可能导致您/贵司的期货账户出现可用资金或权益小于0的情况，以及可能出现因您/贵司期货账户资金不足不能及时支付申报费等费用的情形而产生的重大风险。

7. 当您/贵司当日单合约信息量达到各交易所收费标准时，我司将采用

OTR>2 对应的档位费率标准对您/贵司盘中预收取申报费，因系统前端控制不支持对跨期货公司的交易行为进行监控，且 OTR 标准无法区分档次，可能存在对您/贵司盘中预收取费用少于或多于实际产生申报费的情况，最终您/贵司实际收取的申报费请以当日交易结算单为准。

8. 当您/贵司的期货账户盘中或每日结算时出现资金不足以支付申报费、盈亏或其他我认为必要的情形时，我司有权采取强制风控措施，包括但不限于限制交易、调整保证金率、关闭账户交易权限、对头寸进行强制平仓等措施。

本人/单位承诺如下：

1. 本人/单位已仔细阅读并完全理解各交易所发布的相关制度及通知：自愿遵守期货交易相关的法律、行政法规、规章及交易所各项期货业务规则。

2. 本人/单位知晓各期货交易所收取申报费的规定，知晓各交易所各品种最新申报费收取规则、费率标准及异常交易认定标准等。本人/单位承诺合规使用交易软件以及相关交易指令，知晓所使用的交易软件及交易指令可能产生的申报费扣划风险，且知悉账户因资金不足不能及时支付申报费等费用的情形而产生的重大风险，承担由此产生的责任。

3. 本人/单位知晓金瑞期货股份有限公司对本人/本单位期货账户出现资金不足以支付申报费、盈亏等情形时，将采取强制风控措施，包括但不限于限制交易、关闭账户交易权限、对账户头寸进行强制平仓等措施，并承担由此产生的一切后果。

4. 本人/单位具备期货交易基础知识，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，知悉申报费收取的规则及收取标准，本人/单位承诺持续做好账户交易管理，合规交易，并对期货交易结果承担责任。

客户签章：

年 月 日