

金信期货程序化交易应用情况登记表

| | | | |
|-------------------|--|---------------|---|
| 客户名称 | | 资金账号 | |
| 联系电话 | | 程序化交易 开始日期 | |
| 交易地点 | | | |
| 交易模式 | <input type="checkbox"/> 日内高频 <input type="checkbox"/> 日内非高频 <input type="checkbox"/> 隔夜交易 <input type="checkbox"/> 组合交易 | | |
| | <input type="checkbox"/> 交易主机托管 <input type="checkbox"/> 交易主机不托管（二选一） | | <input type="checkbox"/> 人工手动下单 <input type="checkbox"/> 软件自动下单（二选一） |
| | <input type="checkbox"/> 其他交易模式 | | |
| 软件提供者 | <input type="checkbox"/> 会员提供 <input type="checkbox"/> 客户自编 <input type="checkbox"/> 第三方软件 | | |
| 系统接入 | <input type="checkbox"/> 外接会员 API <input type="checkbox"/> 不外接会员 API | | |
| 软件交易席位 | <input type="checkbox"/> 金仕达 <input type="checkbox"/> CTP <input type="checkbox"/> 易盛 <input type="checkbox"/> 其他_____ | | |
| 软件名称 及 所属厂商 | <input type="checkbox"/> Mytrader 一键通行情交易系统（上海文华财经咨询有限公司） <input type="checkbox"/> 彭博博易大师闪电手交易系统（上海彭博网络数据信息咨询有限公司） <input type="checkbox"/> 快期期货交易终端（上海期货信息技术有限公司） <input type="checkbox"/> 交易开拓者（深圳开拓者科技有限公司） <input type="checkbox"/> 易盛远程交易下单系统（郑州易盛信息技术有限公司） <input type="checkbox"/> 文华财经程序化交易系统（上海文华财经资讯有限公司） <input type="checkbox"/> 投资家（北京博雅讯电子信息技术有限公司） <input type="checkbox"/> 顶点期货交易管理系统（福建顶点软件股份有限公司） <input type="checkbox"/> Quig 量化投资博弈平台（海基投资有限公司） <input type="checkbox"/> 恒生期货网上交易（恒生电子股份有限公司） <input type="checkbox"/> 尊嘉程序化交易分析系统（北京尊嘉资产管理有限公司） <input type="checkbox"/> 金字塔程序化交易（上海金之塔信息技术有限公司） <input type="checkbox"/> 其他软件：（包括客户自主编写的软件，请在下方填写）： 软件名称： _____ 版本号： _____ 软件厂商： _____ | | |
| 软件基本功能 描述 | | | |

交易策略说明

程序化交易风险揭示

尊敬的客户：

为便于您/贵司全面正确地了解与程序化交易系统有关的风险，保护您/贵司的合法权益，请认真阅读并充分了解以下风险事项：

一、程序化交易为客户自主交易决策，由客户自行承担交易结果。

二、在使用程序化交易之前，客户应细心研究并熟悉程序化交易模型，熟悉自动化交易的操作。

三、客户在使用程序化交易系统前应审慎评估自身的经济状况和财务能力，充分考虑是否适宜参与此类交易。

四、若程序化交易软件由客户向第三方软件提供商购买的，本公司仅协助提供标准行情与交易接口。若客户因所购买的程序化交易软件发生错误造成的任何纠纷，由客户与软件提供商协商解决，本公司不承担任何责任。

五、若客户的程序化交易模型的建置和接入影响公司交易系统的正常运行时，本公司有权限制或停止该程序化交易模型的接入运行。

六、任何交易软件和网上交易行为都是存在风险的。客户自愿使用程序化交易系统（软件）进行期货交易，应知晓程序化交易除了具有与其它交易方式共同具有的政策风险、技术风险、市场风险、不可抗力等风险外，还存在（包括但不限于）以下风险，客户将承担由此导致的一切风险和损失：

1、具备自动下单功能的程序化交易系统（软件）有可能存在下达交易指令错误、获取成交结果失败或客户在交易过程中因自身原因进行误操作的风险。

2、通过程序化交易系统（软件）发布的行情及其他信息，有可能出现延迟或错误，从而导致客户做出错误判断。

3、由于停电、网络或通讯出现故障或繁忙、服务器负载过重，或因受到网络黑客、网络病毒的攻击或入侵等原因，程序化交易系统（软件）可能会出现故障，客户可能不能及时或正常进行程序化交易。

4、由于交易所交易规则所限，客户使用程序化交易系统包括但不限于各种自助或预设触发条件的下单功能所发出的交易委托有可能不成交或只是部分成交。

5、由于程序化交易系统（软件）及交易模型的或有缺陷以及其他各种可能的不可预知的原因，客户使用程序化交易进行交易的实际结果有可能与客户的预先设定不一致。实际成交结果，以交易所结算结果为准。

6、由于计算机故障以及互联网数据传输等原因，交易模型指令可能出现中断、停顿、延迟及数据错误，从而造成指令出错、失效及价格滑差等情况。

7、若客户进行交易有关的电脑硬件设备配置、操作系统软件版本与程序化交易模型软件使用的配置要求不相匹配，可能会造成无法给出提示信号或信号消失、操作系统不兼容等后果。

8、因交易过程由网络及设备硬件环境、技术条件、策略设计等多个环节组成，任何环节出现错误或疏忽都可能导致交易中产生损失。

六、程序化交易模型只是作为一个交易辅助工具，本公司对该软件模型的可靠性、准确性、安全性及盈亏率均不做任何形式的保证。客户通过程序化交易系统（软件）参与期货交易均应属于客户独立做出的交易决策，其交易结果由客户自行承担。客户因使用程序化交易发生差错等使用风险的，甚至出现亏损，均须由客户自行承担，本公司不承担任何责任。

七、若程序化交易仅提供下单功能的，出入资金需要切换到本公司系统的，在切换期间引起的交易延误或损失将由客户自行承担，本公司不承担任何责任。

八、客户因保证金不足、大户限仓等原因导致的被迫加保证金、强行平仓等，以及开户、销户、出金、入金等相关业务将以双方签订的《期货经纪合同》中的约定方式执行。客户使用程序化交易系统（软件）进行期货交易，每次开仓、持仓、平仓、撤单等均需符合交易所相关要求（其中包括但不限于最大持仓限额、交割月限仓、单笔最大下单量等）。账户投入总资金量，交易指令流量（单位：笔数/每秒）不得高于期货公司及交易所的限定标准。客户须承诺不进行自成交、频繁报撤单、频繁大额报撤单、关联账户合并持仓超限、影响交割结算价、盗码交易、违规持仓、日内过度交易等异常交易行为，并愿意承担可能的由于异常交易行为导致的处罚及损失。

九、客户须保证不出现干预、入侵、窃取期货公司技术系统和商业信息现象，不对期货公司技术系统或其他客户造成影响，否则期货公司有权临时或永久关闭客户的程序化交易系统（软件）的接入，由此产生的风险和损失由客户承担，由于以上行为给期货公司造成损失的，客户须赔偿损失。

十、客户进行程序化交易，应积极采取安全措施，防范电子化交易风险。

本风险揭示未能尽述一切有关程序化交易系统使用存在的风险事项，客户应在对程序化交易系统充分认知并认可后，方可使用。

客户应当完全了解程序化交易软件的各种风险，并承诺能够独立承担使用程序化交易系统可能出现的风险和承担由此带来的损失，本公司不对客户使用程序化交易系统交易的结果负责。

客户有义务配合期货公司接受监管部门或交易所的延伸检查及报备工作，内容包括但不限于配合尽职调查、接受访谈或接听电话、如实填报相关信息材料等，烦请务必给予理解与配合。

合规操作说明

本人/本单位已知悉上述风险并自愿承担程序化交易产生的交易结果，知悉并承诺遵守交易所关于存在程序化交易及异常交易的有关规则及要求，合法合规参与期货交易，自愿承担相应的法律责任并接受交易所的处理措施。

填报人：

日期：