

大额未平仓合约申报和持仓限额的客户告知书

尊敬的客户：

为了使您充分了解期货及期权业务中关于大额未平仓合约申报和持仓限额的要求，中信期货国际有限公司（“本司”）制定本《大额未平仓合约申报和持仓限额的客户告知书》，请您仔细阅读并理解大额未平仓合约申报和持仓限额的相关义务。在决定进行期货及期权交易之前，您应当充分了解以下事项：

- 1、您在进行期货及期权交易时，应当严格遵守交易所相关业务规则、市场公告中关于大额未平仓合约申报和持仓限额的规定。阁下/贵司有义务对所持大额未平仓合约进行申报，包括阁下/贵司之大额未平仓合约集中于一家交易所参与者（即期货经纪公司），或在多家交易所参与者之持仓总和达到大额未平仓合约申报水平的情况。
- 2、如阁下/贵司在多家交易所参与者之持仓总和达到申报水平时欲要求本司在阁下/贵司在本司的持仓未达申报水平也进行申报的，阁下/贵司必须向本司出具明确的书面授权并提供相关资料，若本司在次交易日早上 9:30 前未收到阁下/贵司明确的书面授权及相关资料，本司仅在阁下/贵司在本司持仓达到申报水平时向交易所进行大额未平仓合约申报，由此产生的迟报、漏报、瞒报等不良后果，将由阁下/贵司自行承担。
- 3、阁下/贵司可通过以下网址查询各交易所和监管部门关于产品的未平仓合约申报水平和持仓限额标准及具体的申报方式等最新监管规定情况：

HKEX 香港交易所

https://www.hkex.com.hk/Services/Trading/Derivatives/Overview/Trading-Mechanism/Large-Open-Positions-and-Position-Limits?sc_lang=zh-HK

CME 芝加哥交易所集团

<https://www.cmegroup.com/market-regulation/position-limits.html>

CFTC 美国商品期货委员会

<https://www.cftc.gov/IndustryOversight/MarketSurveillance/LargeTraderReportingProgram/index.htm>

ICE 洲际交易所集团

<https://www.theice.com/site-search?q=Position%20Limits>

- 4、法团客户请确认以下问题：

(1) 贵司是否属于集团公司的附属公司/子公司？

- 是，请回答以下第(2)问并提供集团公司名称。集团公司¹名称为：_____
- 否。

(2) 贵司是否接受集团公司或集团公司控制的其他公司向贵司发出交易指示？

- 是，发出交易指示的公司名称为：_____
- 否。

吾等已细阅、完全理解并同意以上告知事项。

客户名称：

获授权人姓名：

签署日期：

¹ 如某法人团体 ——

(a)控制贵司的董事局的组成；

(b)控制贵司超过半数的表决权；或

(c)持有贵司超过半数的已发行股本，

则该法人团体即属贵司的集团公司。

贵司集团公司的集团公司亦属于贵司的集团公司，请一并提供相关名称。