郑商函〔2021〕331号

各会员单位：

为进一步加强程序化交易报备工作，根据《郑州商品交易所交易规则》第一百一十条的规定，自2021年7月16日起，郑州商品交易所（以下简称郑商所）对程序化交易客户的交易信息报备要求进行完善。

一、报备标准

郑商所将根据客户的申报、撤单、成交等交易数据，确定需要完善报备信息的程序化交易客户。

对于同一客户在不同期货公司会员处开有多个交易编码的，郑商所对其申报、撤单、成交等指标合并计算。

二、报备要求

对达到报备标准的客户，郑商所将通知客户所在的期货公司会员，期货公司会员应当及时告知客户。客户应当通过期货公司会员向郑商所进行相关信息报备，履行信息报备义务，规范交易行为。

报备内容涉及客户基本信息，以及软件信息、交易策略和风控措施等事项的简要说明。郑商所可以根据客户交易行为、报备信息等要求客户补充报告相关信息。

期货公司会员应当在收到郑商所通知后的10个交易日内，按照郑商所要求通过会员服务系统上报相关信息，每个交易日15:00前上报视为当日报备。

报备客户需向期货公司会员提供签字或盖章版的纸质件，期货公司会员留存纸质件备查。

郑商所对期货公司会员提交的报备材料进行核查，发现信息不全或存有疑义的，将向期货公司会员进行反馈，要求补充材料或进行相关解释。期货公司会员在收到反馈后，应当按照要求及时修改或补充材料后重新进行报备。

请各会员单位高度重视，切实履行报备职责。对于不按要求提供信息或提供虚假信息的程序化交易客户，郑商所将依据情况采取相应自律监管措施。

特此通知。

郑州商品交易所

2021年7月16日