

海通期货股份有限公司期货交易适当性管理办法

第一章 总则

第一条 为贯彻中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）关于期货适当性制度的规定，根据《期货交易管理条例》、《证券期货投资者适当性管理办法》、《境外交易者和境外经纪机构从事境内特定品种期货交易管理暂行办法》、《上海期货交易所期货交易者适当性管理办法》、《郑州商品交易所期货交易者适当性管理办法》、《大连商品交易所期货交易者适当性管理办法》、《上海期货交易所期货交易者适当性管理办法》、《上海国际能源交易中心期货交易者适当性管理细则》、《中国金融期货交易所交易者适当性制度管理办法》等法律法规及各交易所业务规则，切实落实适当性制度具体标准，促进公司期货业务平稳、规范、健康发展，制定本办法。

第二条 在公司开立上海期货交易所、郑州商品交易所、大连商品交易所、上海国际能源交易中心、中国金融期货交易所特定品种期货合约和期权合约交易权限的投资者（包括通过境外中介机构转委托方式开户的投资者）适用于本操作办法。

第三条 本办法所称的交易者是指从事期货交易并承担交易结果的自然人、法人、非法人组织。

第四条 本办法所称的“适当性制度管理”，是指公司在开展特定品种期货、期权业务时，对投资者符合参与特定品种期货、期权交易的条件进行核查，对客户基本情况、相关投资经历、财务状况和诚信状况等进行综合评估。

第五条 公司及各分支机构、海通证券 IB 营业部（以下简称“业务单位”）务必严格执行本操作办法。

第六条 公司经纪业务运营中心、各业务单位应当向客户充分揭示风险，介绍期货、期权交易法律法规、交易所业务规则及有关规定和决定、产品特征，了解客户的期货交易基础知识水平，严格验证客户资金、期货交易经历和仿真交易经历，审慎评估客户的诚信状况和风险承受能力，审核客户交易编码或者交易权限申请材料等开户资料。

第七条 公司经纪业务运营中心、各业务单位应当建立并妥善保管客户资料档案，严格为客户保密。

第八条 投资者应当根据适当性制度的要求，全面评估自身市场及产品认知能力、风险控制与承受能力和经济实力，审慎决定是否参与期货、期权交易。

第九条 境外中介机构委托公司从事境内期货交易的，应当严格按照监管要求执行开户实名制、交易编码制度及交易者适当性等制度，对其投资者进行适当性及实名制审核并留存开户资料及影像资料，其投资者满足交易所适当性准入条件的情况下为其每个客户单独

申请交易编码,不得混码交易。境外中介机构应当对其投资者开户资料及适当性相关资料的真实性、准确性、完整性负责,并承担相应的法律责任。

第十条 交易编码实行权限管理,公司在为客户开立交易编码后,通过适当性评估或者符合豁免条件的,开通相关品种交易权限。

第二章 投资者适当性管理的标准

第十一条 投资者申请交易所特定品种期货合约和期权合约交易权限的,应该符合各交易所适当性制度准入标准。

第十二条 公司可以为符合下列标准的个人客户,实行适当性制度的上市品种申请开立交易编码或开通交易权限:

1. 具备完全民事行为能力;
2. 具备期货交易基础知识,了解相关业务规则,客户本人通过交易所知识测试,测试分数不低于 80 分;
3. 具有累计不少于 10 个交易日且 20 笔及以上的境内交易场所的期货合约或者期权合约仿真交易成交记录;或者近三年内具有 10 笔及以上的境内交易场所的期货合约、期权合约或者集中清算的其他衍生品交易成交记录;或者近三年内具有 10 笔及以上的认可境外成交记录;
4. 申请开立交易编码或者开通交易权限前连续 5 个交易日保证金账户可用资金余额均不低于人民币 10 万元或者等值外币;
参与原油期货交易的,前述保证金账户可用资金余额均不低于人民币 50 万元或者等值外币;
5. 申请中金所交易编码的,前述保证金账户可用资金余额均不低于人民币 50 万元;不存在严重不良诚信记录、被有权监管机关宣布为期货市场禁止进入者和法律、法规、规章、交易所业务规则禁止或者限制从事期货交易的情形;
6. 交易所要求的其他条件。

第十三条 公司可以为符合下列标准的一般单位客户,实行适当性制度的上市品种申请开立交易编码或开通交易权限:

1. 指定下单人具备期货交易基础知识,了解相关业务规则,通过交易所知识测试,测试分数不低于 80 分;
2. 具有累计不少于 10 个交易日且 20 笔及以上的境内交易场所的期货合约或者期权合约仿真交易成交记录;或者近三年内具有 10 笔及以上的境内交易场所的期货合约、期权合约或者集中清算的其他衍生品交易成交记录;或者近三年内具有 10 笔及以上的在与中国证券监督管理委员会(以下简称中国证监会)签署监管合作谅解备忘录的国家(地区)期货监

管机构监管的境外交易场所的期货合约、期权合约或者集中清算的其他衍生品交易成交记录；

3. 申请开立交易编码或者开通交易权限前连续 5 个交易日保证金账户可用资金余额均不低于人民币 10 万元或者等值外币；

参与原油期货交易的，前述保证金账户可用资金余额均不低于人民币 100 万元或者等值外币；

申请中金所交易编码的，前述保证金账户可用资金余额均不低于人民币 50 万元；

4. 具有健全的内部控制、风险管理等期货交易管理相关制度；

5. 不存在严重不良诚信记录、被有权监管机关宣布为期货市场禁止进入者和法律、法规、规章、能源中心业务规则禁止或者限制从事期货交易的情形；

6. 交易所要求的其他条件。

第十四条 一般单位客户是指除特殊单位客户和做市商以外的单位客户。

第十五条 具有境内交易所实行适当性制度的其他上市品种交易权限的客户，申请开立交易所编码或者开通交易权限的，可不对其进行知识测试、交易经历的评估；客户已开通适当性制度的上市品种可用资金不低于新申请品种要求的，可以不再对其进行可用资金的评估。具体情形如下：

1. 客户已经具有其他境内商品期货交易所上市的实行适当性制度的上市品种交易权限；

2. 客户已经具有金融期货交易的交易编码；

3. 客户已经具有境内证券交易所期权交易权限；

4. 客户已经具有实行适当性制度的上市品种交易权限，申请开通其他上市品种的交易权限；

客户应当提供具有上述权限开通的证明资料。客户在我司具有相关特定品种期货、期权开通记录的，申请开通其它品种交易权限的，可以豁免客户提供相关证明材料。

第十六条 除法律、行政法规、规章以及中国证监会另有规定外，为以下客户参与交易实行适当性制度的上市品种申请开立交易编码或者开通交易权限的，可以不对其知识测试要求、交易经历、可用资金要求进行评估：

1. 符合《证券期货投资者适当性管理办法》规定的专业投资者，提供适当性认定为专业投资者的证明材料；

2. 已在其他公司开通实行适当性制度的某一品种交易权限的，再通过我司开通该品种交易权限的客户，提供具有相关交易权限的证明材料；

3. 近一年内具有累计不少于 50 个交易日境内交易场所的期货合约、期权合约或者集中清算的其他衍生品交易成交记录或者认可境外成交记录，提供近一年内 50 个交易日的成交记录证明材料；

4. 做市商、特殊单位客户等交易所认可的其他交易者。

第十七条 特殊单位客户是指期货公司、证券公司、基金管理公司、信托公司和其他金融机构，以及社会保障类公司、合格境外机构投资者等法律、行政法规和规章规定的需要资产分户管理的单位客户。

第三章 基础知识要求

经办：业务单位开户人员

复核：经纪业务运营中心二次审核

第十八条 公司业务单位开户人员组织参与特定品种期货和期权交易的客户通过登录中国期货业协会期货投资者适当性知识测试平台在线测试。

第十九条 投资者参与测试前开户人员严格验证投资者身份，确保知识测试应由客户本人或单位客户的指定下单人全程独立自主完成，不得由他人代替。对于通过知识测试的客户，知识测试监督人员与客户应当在成绩单上签字确认。

第二十条 测试完成后，投资者在考试成绩单上签署承诺考试过程是由本人全程独立自主完成，自然人由本人签署，单位客户由指定下单人签署。业务单位开户人员审核要求：

1. 知识测试总分 100 分，80 分为合格，测试成绩长期有效；
2. 客户开发人员不得兼任知识测试监督人员；
3. 一般单位客户所有指定下单人均需通过测试。

第二十一条 对于未通过知识测试的客户，可以加强对客户的培训和指导，培训后再组织其参加测试。

第二十二条 境外客户可以通过出具承诺函的方式表明其具有交易所要求的知识水平，同时要承担提供不实承诺的后果。

第二十三条 经纪业务运营中心、业务单位应当将客户符合适当性制度要求的知识测试试卷和境外客户承诺函作为开户资料予以保存，随同开户资料存档。

第四章 交易经历要求

经办：业务单位开户人员

复核：经纪业务运营中心二次审核

第二十四条 公司经纪业务运营中心、业务单位开户人员为参与特定品种期货和期权交易的客户向交易所申请交易编码或开通交易权限前，严格审核客户交易经历，确认投资者具备交易所要求的境内外期货交易经历，具体要求如下：

1. 仿真交易经历

交易所以及境内其他交易场所的联调测试系统、仿真系统的期货或者期权的仿真交易经

历均为交易所认定的仿真期货交易经历。

客户应当提供由证券公司、期货公司等机构出具的仿真交易结算单、交易所会服截图等文件，证明其具有累计不少于 10 个交易日、合计 20 笔以上（含 20 笔）的仿真交易成交记录。

2. 境内期货交易经历

客户应当提供由证券公司、期货公司等机构出具的交易结算单等单据，证明其近三年内具有 10 笔以上（含 10 笔）的期货、期权或者集中清算的其他衍生品交易的成交记录作为证明。

3. 境外交易经历

客户应当提供在中国证监会签署合作谅解备忘录的国家（地区）期货监管机构监管的境外交易场所的交易记录明细、结算单据或者其他凭证，证明其近三年内具有 10 笔以上（含 10 笔）的期货、期权或者集中清算的其他衍生品交易（如掉期交易）的成交记录。

4. 1 笔委托分次成交的视为 1 笔成交记录，所有上述交易记录应当为实际（仿真）成交的交易记录。

第二十五条 经纪业务运营中心、分支机构、IB 营业部均必须妥善保管投资者交易经历证明，随同开户资料存档。

第五章 可用资金要求

经办：业务单位开户人员

复核：经纪业务运营中心二次审核

第二十六条 公司业务单位开户人员负责投资者可用资金具体查询，经纪业务运营中心账户管理岗进行可用资金审核。客户保证金账户可用资金余额以公司结算部提供客户资金对账单为准。为客户申请开立交易编码或者开通交易权限的，确认客户申请日前连续 5 个交易日每日结算后，客户在公司的保证金账户可用资金余额均不得低于交易所规定的标准。

第二十七条 可用资金余额证明材料需加盖公司结算专用章。

第二十八条 客户可用资金计算以公司收取该客户保证金标准为计算依据。人民币和外币余额加总计算，外币与人民币之间的换算公式为：

折后（人民币）金额=外币金额×中国外汇交易中心发布的当日外汇兑人民币汇率中间价×外汇充抵折扣率。

其中，外币是指交易所规定的可作为保证金使用的外汇资金。可用外币币种和外汇充抵折扣率由交易所另行公布。

第二十九条 经纪业务运营中心账户管理岗为客户申请开立交易编码或者开通交易权限的，应当确认申请日前连续 5 个交易日每日结算后，客户在公司保证金账户可用资金余额

均不低于交易所规定的标准。

第三十条 境外特殊经纪参与者、境外中介机构为客户申请开立交易编码或者开通交易权限的，应当确认申请日前连续 5 个交易日，该客户在该境外特殊经纪参与者或者境外中介机构处的保证金账户可用资金余额均不低于交易所规定的标准。

第三十一条 经纪业务运营中心、业务单位均必须妥善保管投资者可用资金证明材料，随同开户资料存档。

第六章 合规诚信要求

经办：业务单位开户人员

复核：经纪业务运营中心二次审核

第三十二条 经纪业务运营中心、业务单位开户人员要严格审查投资者诚信信息，不得为存在严重不良诚信记录或者被有监管权机关宣布为期货市场禁止进入者的情形的客户申请交易编码或开通交易权限；不得为存在法律、行政法规、规章和交易所业务规则禁止或者限制从事期货交易的情形的客户申请交易编码或开通交易权限。各部门开户人员应当向客户明示有关禁止或者限制从事期货交易的规定和要求。

第三十三条 经纪业务运营中心、各业务单位开户人员通过中国证监会证券期货市场失信记录查询平台 (<http://shixin.csrc.gov.cn/honestypub/>)、中国期货业协会行业信息管理平台 (<http://db.cfachina.org/CFA/>)、信用中国 (<https://www.creditchina.gov.cn>) 等平台对境内外客户诚信情况进行查询。查询人员在诚信查询证明材料上签字确认。

第三十四条 投资者签署《海通期货业务办理申请表》，承诺其不存在法律、法规、规章和特定品种业务规则禁止或者限制从事期货交易的情形。

第三十五条 经纪业务运营中心、业务单位均必须妥善保管投资者诚信证明材料，随同开户资料存档。

第七章 交易编码或开通交易权限申请流程

第三十六条 交易编码实行权限管理。客户交易编码申请后，通过适当性评估或者符合豁免条件的，公司经纪业务运营中心按照客户申请，开通相关品种的交易权限。

第三十七条 符合特定品种期货或期权交易适当性条件的客户应当向公司提出申请，新增或者关闭上市品种交易权限。

第三十八条 投资者向公司提出开通交易编码或开通权限申请，同时填写《海通期货业务办理申请表》，如实申报交易编码或交易权限申请材料，不得采取虚假申报等手段规避交易者适当性制度要求。

第三十九条 投资者应当对其所提供的适当性材料的真实性、有效性负责，对其所提供

的虚假证明材料承担相应责任，投资者签署《海通期货业务办理申请表》，个人客户由本人签字，单位客户由被授权人签字并加盖公章。

第四十条 公司各业务单位开户人员在为客户申请交易编码或开通交易权限前，应做好客户的适当性匹配工作，为对应匹配等级的投资者办理开户手续。

第四十一条 公司业务单位开户人员应当向客户充分揭示期货交易风险，客观介绍期货交易法律法规、交易所业务规则等。

第四十二条 投资者申请交易编码或开通交易权限，应当符合交易所适当性制度标准，各业务单位开户人员对投资者适当性证明材料进行审核，经纪业务运营中心进行复审。

第四十三条

公司业务单位开户人员在审核客户申请材料时，审核的要求如下：

1. 客户身份证明文件在有效期内；
2. 《海通期货业务办理申请表》上的勾选项和投资者签名完整；
3. 测试成绩在 80 分以上，成绩单上知识测试监控人员和客户均需签名；
4. 知识测试成绩、交易经历、合规诚信等规定的证明材料是否满足适当性标准，各项评估内容的证明材料是否齐全；
5. 真实、仿真交易经历证明材料齐全；
6. 在中国期货业协会的投资者信用风险信息数据库信息、证券期货市场失信记录查询平台以及涉金融严重失信人员名单，投资者不存在严重不良记录；
7. 可用资金余额证明材料是符合交易所资金要求，且加盖结算专用章；
8. 单位客户具有参与期货交易的内部控制、风险管理等期货交易管理相关制度；
9. 单位客户办理特定品种期货、期权交易申请的，开户代理人及相关指定人员的有效身份证明文件在有效期内且留存的证明文件复印件齐全；
10. 豁免情形的证明材料符合交易所要求且在有效期内。

第四十四条 公司经纪业务运营中心工作人员的职责包括：

1. 审核投资者适当性等级和申请的业务类型是否相匹配；
2. 审核投资者知识测试分数、交易经历、保证金账户可用资金、豁免的证明材料是否符合适当性制度要求，审核客户资料是否符合实名制开户要求；审核《海通期货业务办理申请表》填写内容是否完整；
3. 对于审核通过的客户为其申请交易编码或开通交易权限；
4. 客户开通实行适当性制度的上市品种交易权限后 3 个工作日内，经纪业务运营中心账户管理岗应当通过会员服务系统报备开通交易权限的交易编码。销户或者客户申请关闭相关交易权限的，经纪业务运营中心账户管理岗应当在 3 个交易日内撤销报备。

第四十五条 公司经纪业务运营中心、业务单位应加强对上述材料的审核。针对不符合

特定品种期货、期权投资者适当性要求的客户，严禁为其开通交易权限。

第四十六条 公司经纪业务运营中心、业务单位应该妥善保管基础知识、交易经历、可用资金、合规诚信、豁免情形等规定的证明材料及身份证明文件材料。

第四十七条 境外中介机构通过监控中心统一开户系统提交投资者的开户申请后，公司经纪业务运营中心登录中国期货市场监控中心同意或者驳回该申请。境外中介机构应当对其投资者开户资料及适当性相关资料的合规性、真实性、准确性、完整性负责，并承担相应的法律责任。

第八章 其它

第四十八条 经纪业务运营中心合同管理员、业务单位开户人员、IB 营业部专职业务人员负责保管客户资料，妥善保存权限申请表、可用资金证明材料、知识测试成绩单、交易经历证明材料以及客户提供的用于适当性评估的其他证明文件及相关材料的原件或者复印件，并建立客户资料档案；客户通过在线申请的，做好电子档案的保存，以备交易所及其他监管机构核查。档案资料应当自期货经纪合同终止之日起至少保存 20 年。除依法接受调查和检查外，应当严格为客户保密。

第四十九条 客户不得进行虚假性、误导性或者遗漏重要事实的申报、陈述、解释或者说明。

第五十条 业务单位应督促客户遵守期货交易相关法律、行政法规、部门规章、交易所业务规则及有关规定和决定，持续开展客户风险教育，加强客户交易行为的合法与合规性管理。

第九章 附则

第五十一条 本办法由经纪业务运营中心负责解释和修订。

第五十二条 本办法自发布之日起正式实施。