

海通期货股份有限公司

资产管理业务投资者适当性管理办法实施细则

第一章 总则

第一条 为了保障海通期货股份有限公司（以下简称“公司”）资产管理业务的规范、健康运行，保护投资者的合法权益，控制资产管理业务风险，有效落实适当性管理要求，根据《海通期货股份有限公司投资者适当性管理办法》（试行）及公司相关内控制度，制定本细则。

第二条 本细则所称的“投资者适当性管理”，是指公司在销售资管产品或者服务过程中，全面了解投资者情况，科学有效评估，充分揭示风险，根据投资者的风险承受能力销售不同风险等级的资管产品或者服务，把合适的资管产品或者服务销售给合适的投资者。

第三条 资产管理部为资产管理业务适当性管理部门，负责公司资产管理业务适当性管理要求的具体落实。

第四条 业务单位开户人员作为投资者适当性的分类评估、投资者与产品服务的匹配、适当性回访的参与者，必须参加资产管理部组织的业务培训并通过知识及技能测试，方可参与适当性的分类评估、投资者与产品服务的匹配、适当性回访。

第五条 销售人员不得参与投资者的分类评估，以及投资者与产品服务的匹配。

第六条 公司所属业务单位在向投资者销售产品或提供服务时务必严格按照本细则执行。

第二章 适当性相关人员职责

第七条 各业务单位开户人员主要职责：

（一）负责核对投资者身份信息，指导投资者签署适当性相关材料，并根据所提供的相关证明材料进行初审；

（二）根据投资者提供的材料，进行投资者分类，投资者风险承受能力等级、以及投资者与产品服务的匹配结果初审；

（三）负责向普通投资者告知适当性匹配意见、揭示购买产品和接受相关服务存在的风险等相关事宜，并做好留痕；

（四）负责适当性管理系统提交投资者适当性材料；

(五) 负责投资者适当性纸质资料和电子文本的建档和保管，做好相关适当性资料保密工作，并向资产管理部实时传递工作；

(六) 负责配合资产管理部做好适当性回访工作；

(七) 负责配合资产管理部做好投资者适当性持续管理。

第八条 资产管理部主要职责：

(一) 负责业务单位适当性培训工作及知识测试；

(二) 负责对业务单位提交的投资者适当性资料、双录文件的完整性和合规性进行审核；

(三) 根据业务单位提交的投资者适当性资料，确定投资者类型、风险承受能力等级以及投资者与产品及服务的匹配结果；

(四) 在投资者匹配对应产品服务，购买资管产品前，做好投资者适当性回访工作，组织业务单位做好后续适当性回访工作；

(五) 负责所有投资者适当性纸质资料和电子文本的建档和保管，做好相关适当性资料保密工作；

(六) 负责投资者适当性投诉受理；

(七) 负责投资者适当性持续跟踪和管理。

第三章 了解投资者

第九条 业务单位开户人员在为投资者办理业务前，应遵循“把适合的产品销售给适当的投资者”原则为前提，通过收集投资者资料、现场或非现场方式与投资者沟通，初步了解投资者的业务需求，为其开展适当性评估工作。

业务单位开户人员根据投资者身份证明文件，指导投资者填写《海通期货投资者基本信息表》（附件1），并进行初审；资产管理部账户管理岗进行复审，审核通过后由适当性管理系统保存投资者信息资料。

第十条 投资者不按照规定提供相关信息，提供信息不真实、不准确、不完整的，应当依法承担相应法律责任，业务单位应当告知其后果，并拒绝投资者的相关业务申请。

第四章 投资者分类

第十一条 投资者购买资管产品时，需要了解投资者的信息，包括但不限于以下信息：

(一) 收入来源和数额、资产、债务等财务状况；

- (二) 投资相关的学习、工作经历及投资经验;
- (三) 投资期限、品种、期望收益等投资目标;
- (四) 风险偏好及可承受的损失;
- (五) 诚信记录;
- (六) 实际控制投资者的自然人和交易的实际受益人;
- (七) 法律法规、自律规则规定的投资者准入要求相关信息;
- (八) 其他必要信息。

第十二条 业务单位开户人员根据所了解的投资者信息,结合《海通期货股份有限公司投资者适当性管理办法》(试行)投资者分类标准,对投资者进行初步分类,将投资者分为专业投资者与普通投资者,并根据投资者分类情况指导投资者签署相关资料,实施差异化适当性管理。

第十三条 专业投资者应当符合下列条件之一:

(一) 经有关金融监管部门批准设立的金融机构,包括证券公司、期货公司、基金管理公司及其子公司、商业银行、保险公司、信托公司、财务公司等;经行业协会备案或者登记的证券公司子公司、期货公司子公司、私募基金管理人。

(二) 上述机构面向投资者发行的理财产品,包括但不限于证券公司资产管理产品、基金管理公司及其子公司产品、期货公司资产管理产品、银行理财产品、保险产品、信托产品、经行业协会备案的私募基金。

(三) 社会保障基金、企业年金等养老基金,慈善基金等社会公益基金,合格境外机构投资者(QFII)、人民币合格境外机构投资者(RQFII)。

(四) 同时符合下列条件的法人或者其他组织:

- 1、最近 1 年末净资产不低于 2000 万元;
- 2、最近 1 年末金融资产不低于 1000 万元;
- 3、具有 2 年以上证券、基金、期货、黄金、外汇等投资经历。

(五) 同时符合下列条件的自然人投资者:

- 1、近一个月金融资产不低于 500 万元,或者最近 3 年个人年均收入不低于 50 万元;
- 2、具有 2 年以上证券、基金、期货、黄金、外汇等投资经历,或者具有 2 年以上金融产品设计、投资、风险管理及相关工作经历,或者属于本条第(一)项规定的专业投资者的高级管理人员、

获得职业资格认证的从事金融相关业务的注册会计师和律师。

前款所称金融资产，是指银行存款、股票、债券、基金份额、资产管理计划、银行理财产品、信托计划、保险产品、期货及其他衍生产品等。

第十四条 符合本细则第十三条第（一）（二）（三）项条件的特殊单位认定为专业投资者时，应当提供：

- 1、营业执照、金融机构业务许可证（包括私募牌照）、产品成立备案文件等身份资质证明材料；
- 2、特殊单位委托代理人（需提供法定代表人授权书）如实填写的《海通期货投资者基本信息表》（机构）（附件 1.2）。

第十五条 符合本细则第十三条第（四）项条件的一般单位投资者认定为专业投资者时，应当提供：

- 1、最近一年经审计的财务报表、金融资产证明文件、本机构的投资经历等；
- 2、一般单位委托代理人（需提供法定代表人授权书）如实填写的《海通期货投资者基本信息表》（机构）、《海通期货专业投资者申请书》（附件 3）。

第十六条 符合本细则第十三条第（五）项条件的自然人投资者认定为专业投资者时，应当提供：

- 1、最近一个月本人的金融资产证明文件或近 3 年收入证明，投资经历或工作证明、职业资格证书等；
- 2、自然人投资者本人如实填写的《海通期货投资者基本信息表》（自然人）（附件 1.1）、《海通期货专业投资者申请书》。

第十七条 认定为专业投资者具体流程如下：

（一）业务单位开户人员对投资者提供的专业投资者证明材料及签署的申请进行初审，指导投资者填写《海通期货专业投资者申请书》，审核通过，填写初审人评估意见且签字确认，初步认定其为专业投资者，并指导投资者签署《海通期货专业投资者告知及确认书》（附件 2），签字并加盖公章；

（二）业务单位开户人员在适当性管理系统上传客户提供的证明材料、《海通期货专业投资者申请书》及《海通期货专业投资者告知及确认书》；

（三）资产管理部账户管理岗对业务单位提交申请材料进行复审，审核通过，由资产管理部最终认定其为专业投资者。资产管理部账户管理岗工作人员在《海通期货专业投资者告知及确认书》

填写评估意见并签字确认，并加盖海通期货资管业务专用章；

（四）复审不通过的由资产管理部拒回投资者申请，由投资者补齐资料后再重新提交申请，并由资产管理部账户管理岗再次复审；

（五）《海通期货专业投资者告知及确认书》一式三份，资产管理部、业务单位、投资者各留存一份。

第十八条 专业投资者之外的投资者为普通投资者，普通投资者在信息告知、风险警示、适当性匹配等方面享有不同于专业投资者的特别保护。

第十九条 资产管理部制作了普通投资者风险承受能力评估问卷以了解投资者风险承受能力情况，问卷内容包括但不限于收入来源、资产状况、债务、投资知识和经验、风险偏好、诚信状况等因素，从多个维度全面综合评估投资者风险承受能力，合理设定选项的分值和权重，建立评估得分与风险承受能力等级的对应关系。

第二十条 资产管理部根据问卷测评分值，对其风险承受能力进行综合评估，将普通投资者按其风险承受能力由低到高分别为 C1（含风险承受能力最低类别）、C2、C3、C4、C5 类。问卷测评分值在 15 分及以下的投资者，风险承受能力为 C1 类；问卷测评分值在 16-28 分的投资者，风险承受能力为 C2 类；问卷测评分值在 29-42 分的投资者，风险承受能力为 C3 类；问卷测评分值在 43-70 分的投资者，风险承受能力为 C4 类；问卷测评分值在 71 分及以上的投资者，风险承受能力为 C5 类。

第二十一条 普通投资者风险承受能力评估流程如下：

（一）投资者本人如实填写并签署《海通期货投资者风险承受能力调查问卷》（附件 4），由业务单位开户人员审核评估问卷，确定问卷分值，同时将问卷上传适当性管理系统；

（二）资产管理部对业务单位开户人员提交的《海通期货投资者风险承受能力调查问卷》、普通投资者与产品的匹配结果及系统录入的相关信息进行审核，审核通过的，最终确定投资者风险承受能力等级。

第二十二条 风险承受能力经评估为 C1 类的自然人投资者，符合以下情形之一的，公司将其认定为风险承受能力最低类别的投资者：

（一）不具有完全民事行为能力；

（二）没有风险容忍度或者不愿承受任何投资损失；

(三) 法律、行政法规规定的其他情形。

公司对于风险等级承受能力最低类别的投资者制定其他更为严格的要求的，应当适用更为严格的规定。

第五章 适当性匹配与管理

第二十三条 业务单位按照“适当的产品（服务）销售给适当的投资者”的原则销售产品或者提供服务，应当遵守下列匹配要求：

- (一) 投资期限、投资品种、期望收益等符合投资者的投资目标；
- (二) 产品或服务风险等级符合投资者的风险承受能力等级；
- (三) 中国证监会、中国期货业协会和经营机构规定的其他匹配要求。

第二十四条 普通投资者风险承受能力等级与产品或服务风险等级的匹配，应当按照以下标准确定：

- (一) C1 类投资者（含风险承受能力最低类别）可购买或接受 R1 风险等级的产品或服务。
- (二) C2 类投资者可购买或接受 R2 及以下风险等级的产品或服务。
- (三) C3 类投资者可购买或接受 R3 及以下风险等级的产品或服务。
- (四) C4 类投资者可购买或接受 R4 及以下风险等级的产品或服务。
- (五) C5 类投资者可购买或接受 R5 及以下风险等级的产品或服务。

第二十五条 专业投资者可购买或接受所有风险等级的产品或服务。

第二十六条 业务单位向普通投资者提供资管产品或服务前，应明确告知投资者下列信息：

- (一) 可能直接导致本金亏损的事项；
- (二) 可能直接导致超过原始本金损失的事项；
- (三) 因公司或相关机构的业务或者财产状况变化，可能导致本金或者原始本金亏损的事项；
- (四) 因公司或相关机构的业务或者财产状况变化，影响投资者判断的重要事由；
- (五) 限制销售对象权利行使期限或者可解除合同期限等全部限制内容；
- (六) 适当性匹配意见。

第二十七条 普通投资者购买资管产品时，业务单位应告知投资者，综合考虑自身风险承受能力与公司的适当性匹配意见，独立做出投资决策并承担投资风险；公司提出的适当性匹配意见不表明其对产品或者服务的风险和收益做出实质性判断或者保证，其履行投资者适当性职责不能取代投

投资者的投资判断，不会降低产品或者服务的固有风险，也不会影响其依法应当承担的投资风险、履约责任以及费用。

第二十八条 普通投资者适当性匹配流程：

（一） 业务单位开户人员在普通投资者完成风险承受能力评估、产品或服务风险等级评级后，进行适当性匹配，指导投资者签署《海通期货普通投资者适当性匹配意见告知书》（附件 5）；

（二） 业务单位开户人员将投资者签署《海通期货普通投资者适当性匹配意见告知书》、普通投资者与产品的匹配结果及录音录像文件通过适当性管理系统提交至资产管理部审核；

（三） 审核通过后，由资产管理部最终确定投资者与产品服务的匹配结果，符合资管产品准入条件要求的，可继续购买风险等级匹配的资管产品；审核不通过，拒回业务单位，待投资者符合要求后再次提交申请；

（四） 资产管理部账户管理岗在审核通过的《海通期货普通投资者适当性匹配意见告知书》原件上加盖海通期货资管业务专用章；

（五） 《海通期货普通投资者适当性匹配意见告知书》一式三份，资产管理部、业务单位、投资者各保留一份。

第二十九条 业务单位开户人员通过现场方式向普通投资者进行告知、警示程序的，应按照公司统一风险揭示模版执行，并对告知、警示全过程录音、录像。

第三十条 普通投资者适当性不匹配的，业务单位禁止误导投资者购买与其风险承受能力不相符合的产品；禁止向风险识别能力和风险承受能力低于产品风险等级的投资者销售资产管理计划。

第三十一条 风险承受能力最低类别投资者只可购买或接受 R1 风险等级的产品或服务，不能跨级购买或接受其他等级的产品或服务。

第三十二条 向普通投资者销售或者提供高风险等级的产品或服务时，应当履行以下适当性义务：

（一） 要求个人投资者提供能证明其最近三个月金融资产高于 300 万或者提供个人连续 3 年高于 50 万的收入证明；一般单位投资者提供净资产不低于 1000 万元的证明；

（二） 要求投资者签署《海通期货普通投资者购买高风险等级产品或者服务风险警示书》（附件 9），揭示该产品或者服务的高风险特征；

（三） 给予投资者至少 24 小时的冷静期（自客户申请日的下一日开始计算）或至少增加一次

回访告知特别风险；

（四）《海通期货普通投资者购买高风险等级产品或者服务风险警示书》一式三份，资产管理部、业务单位、投资者各保留一份。

第三十三条 投资者信息发生变化的，应主动联系资产管理部变更其相关信息。资产管理部应判断其信息发生变化是否影响了投资者与产品或服务的匹配，主动调整投资者分类、产品或服务分级以及适当性匹配意见，并告知投资者。

若调整后适当性匹配意见由匹配变为不匹配，且投资者继续坚持持有或购买原风险等级对应的产品或服务的，业务单位应当再次对投资者变更后的相关信息进行风险承受能力评级，若再次评级后的风险等级与其所持有资管产品风险等级不匹配或投资者拒绝进行风险承受能力评级的，业务单位不再接受投资者申购申请，但投资者可以继续持有已购买资管产品份额至产品终止，或提前赎回。

第三十四条 公司委托其他机构销售本公司发行的产品或者提供服务，应与公司签署相关代销协议，确认受托机构具备销售相关产品的资格及落实适当性义务要求的人员、内控制度、技术设备 etc 能力。

（一）确认代销机构具备代销相关产品的资格和落实适当性义务要求的能力，对代销机构进行尽职调查，并提供相关证明材料，包括但不限于：代销机构牌照及营业执照等；

（二）告知代销机构公司的适当性管理的标准和要求，由代销机构针对其客户，按照标准和要求严格履行投资者风险承受能力分类、适当性匹配等适当性义务，但法律、行政法规、中国证监会其他规章另有规定的除外。

第六章 普通投资者转换为专业投资者

第三十五条 普通投资者和专业投资者在一定条件下可以互相转化，资产管理部根据《指引》要求对提出转化申请的投资者进行审核。

第三十六条 普通投资者申请转化为专业投资者，向业务单位提出转化为专业投资者申请，需持有公司资管产品 2 个月以上，并提供相关证明材料。

第三十七条 符合下列条件之一的普通投资者，可以申请转化为专业投资者：

（一）最近 1 年末净资产不低于 1000 万元，最近 1 年末金融资产不低于 500 万元，且具有 1 年

以上证券、基金、期货、黄金、外汇等投资经历的除专业投资者外的法人或其他组织；

（二）金融资产不低于 300 万元或者最近 3 年个人年均收入不低于 30 万元，且具有 1 年以上证券、基金、期货、黄金、外汇等投资经历或者 1 年以上金融产品设计、投资、风险管理及相关工作经历的自然人投资者。

第三十八条 普通投资者转化为专业投资者，申请转化流程如下：

（一）业务单位开户人员审核投资者身份证明文件、金融资产及投资者经历证明材料，指导投资者签署《海通期货普通投资者转化为专业投资者申请书》（附件 6），确认自主承担可能产生的风险和后果。

（二）一般机构投资者、自然人投资者提供的证明材料：

1、自然人投资者提供：最近一个月本人的金融资产证明、或近 3 年收入证明；本人的投资经历证明，或相关职业资格或职业经历证明。

2、一般机构投资者提供：最近一年经审计的财务报表；最近一年本机构的金融资产证明；本机构的投资经历证明。

（三）审核投资者金融资产及投资经历等证明材料的完整性，留存相关材料的原件或者复印件，核对《海通期货普通投资者转化为专业投资者申请书》签字与预留签字是否一致。

（四）审核通过的，业务单位开户人员指导投资者签字确认《海通期货专业投资者告知及确认书》，初步认定其为专业投资者，业务单位开户人员在《海通期货普通投资者转化为专业投资者申请书》填写评估意见并签字确认。

（五）业务单位开户人员在适当性管理系统界面进行相关信息录入，并上传转化证明材料及签署的《海通期货普通投资者转化为专业投资者申请书》《海通期货专业投资者告知及确认书》。

（六）业务单位开户人员通过现场方式向普通投资者转化进行告知、警示程序的，应该对全过程录音、录像。

（七）资产管理部账户管理岗对业务单位开户人员提交的《海通期货普通投资者转化为专业投资者申请书》《海通期货专业投资者告知及确认书》、专业证明材料、专业投资者认定结果、录音录像留痕及系统录入的相关信息进行审核。

（八）审核通过的，在《海通期货普通投资者转化为专业投资者申请书》填写评估意见并签

字，最终确定普通投资者转化为专业投资者；审核不通过的，由资产管理部拒回业务单位，由投资者补齐资料后再重新提交申请，资产管理部复审。

（九）资产管理部账户管理岗在审核通过的《海通期货专业投资者告知及确认书》原件上加盖海通期货资管业务专用章。

（十）《海通期货专业投资者告知及确认书》一式三份，资产管理部、业务单位、投资者各留存一份。

第七章 专业投资者转换为普通投资者

第三十九条 认定为专业投资者自然人和一般单位投资者，可以申请转化为普通投资者。

第四十条 专业投资者转化为普通投资者，申请转化流程如下：

（一）投资者向业务单位申请转化，业务单位开户人员指导投资者签署《海通期货专业投资者转化为普通投资者确认书》（附件7）。

（二）业务单位开户人员核对投资者身份证明文件，留存相关材料的原件或者复印件，核对《海通期货专业投资者转化为普通投资者确认书》签字与预留签字是否一致。审核通过的，业务单位开户人员在《海通期货专业投资者转化为普通投资者确认书》受理栏填写意见并签字确认。

（三）《海通期货专业投资者转化为普通投资者确认书》一式三份，资产管理部、业务单位、投资者各留存一份。

第四十一条 业务单位开户人员受理确认后应当按照普通投资者的标准，对投资者履行相应的适当性评估、匹配与管理义务，具体流程参照普通投资者适当性匹配流程。

第八章 产品（服务）分级

第四十二条 根据中国期货业协会制定期货行业的产品或者服务风险等级名录，参照中国证券投资基金业协会的“基金产品或者服务风险等级名录”，公司将资管产品由低到高划分为五级，分别为R1级、R2级、R3级、R4级、R5级。

R1级为产品结构简单，过往业绩及净值的历史波动率低，投资标的流动性很好、不含衍生品，估值政策清晰，杠杆不超过监管部门规定的标准；

R2级为产品结构简单，过往业绩及净值的历史波动率较低，投资标的流动性好、投资衍生品以套期保值为目的，估值政策清晰，杠杆不超过监管部门规定的标准；

R3 级为产品结构较简单，过往业绩及净值的历史波动率较高，投资标的流动性较好、投资衍生品以对冲为目的，估值政策清晰，杠杆不超过监管部门规定的标准；

R4 级为产品结构较复杂，过往业绩及净值的历史波动率高，投资标的流动性较差，估值政策较清晰，一倍（不含）以上至三倍（不含）以下杠杆；

R5 级为产品结构复杂，过往业绩及净值的历史波动率很高，投资标的流动性差，估值政策不清晰，三倍（含）以上杠杆。

第四十三条 资产管理部制作产品或服务风险等级评估表，综合考虑流动性、到期时限、杠杆情况、结构复杂性、投资单位产品或者相关服务的最低金额、投资方向和投资范围、募集方式、发行人等相关主体的信用状况、同类产品或者服务过往业绩等因素，根据风险特征和程度审慎评估、划分风险等级，确定各项评估因素的分值和权重，建立评估分值与产品或服务风险等级的对应关系。

第四十四条 资管产品评估流程如下：

（一）资管产品成立初期，由资产管理部数据维护岗在适当性系统界面中根据产品要素表及其相关内容，如实填写“产品或服务风险等级评估表”，确定产品分值，结合评估分值与产品或服务风险等级的对应关系，初步确定资管产品风险等级。

（二）资产管理部数据管理岗对数据维护岗提交的产品评估表，在适当性系统中进行复审，审核通过后，将评估结果提交公司投决会。

（三）由公司投决会结合评估结果对其风险进行综合评估，确定产品风险等级。

第四十五条 出现以下情况时，资管产品或服务风险等级需重新评估：

（一）中国期货业协会更新产品或服务风险等级名录（名录以公告形式每年发布一次，如产品或服务发生变化，协会应根据情况及时更新名录）；

（二）资管产品的相关要素出现变更，经公司投决会通过后，对资管产品重新进行评估流程。

第四十六条 资管产品或服务风险等级重新评估流程：

（一）根据变更后的产品名录内容更新产品分级标准：

- 1、调整或新增相关内容，变更风险等级评估表；
- 2、设定对应分值，划分新风险等级区间；
- 3、抽取部分存续期产品进行样本测算；
- 4、确定并符合新产品名录的产品风险等级。

(二) 适当性系统中对存续产品进行二次评估，确定产品或服务的风险等级

第四十七条 资管产品及服务分级发生变化后，导致投资者风险承受能力等级低于投资者所购买或接受的产品或服务时，业务单位应及时将调整后的产品服务分级告知投资者，同时对投资者重新进行适当性评估。

第九章 适当性留痕管理

第四十八条 投资者进行下述场景告知、警示的，应当全过程录音或者录像：

- (一) 普通投资者转化为专业投资者；
- (二) 投资者主动要求购买风险等级高于其风险承受能力的产品或者接受相关服务的；
- (三) 投资者信息变化导致适当性评估和匹配结果发生变化，应当及时告知投资者，公司提供的服务发生变化的，应当及时更新服务分级与适当性匹配意见，并将更新结果告知投资者；
- (四) 对普通投资者的告知义务，业务单位开户人员向普通投资者提供服务前，应当告知可能的风险事项及明确的适当性匹配意见。

第四十九条 业务单位开户人员通过现场方式双录需符合以下几点要求：

- (一) 业务单位开户人员对投资者履行告知、警示程序的，须由投资者本人或普通机构投资者指定的被授权人参加；
- (二) 向投资者说明对普通投资者和专业投资者履行适当性义务的差别，警示可能出现的风险，并告知转化结果；
- (三) 业务单位开户人员在与投资者互动的过程中应确认投资者的回答是否符合要求，如投资者的回答符合要求则继续录制，如不符合要求则停止录制，指导投资者仔细了解相关业务规则、风险点和适当性匹配意见后重新开始双录；
- (四) 背景光线应当适宜，录制的声音应该清晰；
- (五) 互动环节投资者的回答符合要求，互动过程清晰无杂音；
- (六) 录制过程能清晰辨别员工和投资者的面部特征；
- (七) 录制内容完整、整个过程连续，没有中断。

第五十条 资产管理部除销售人员以外的人员，以录音电话、电邮、信函等适当方式、每年至少抽取 30%比例对普通投资者进行适当性回访。回访人员严格按照公司统一回访模板执行，并建立回访台账，同时在适当性管理系统保存回访记录。对于下列普通投资者，资产管理部应当每年进行

回访：

- （一） 生活来源主要依靠积蓄或社会保障的；
- （二） 购买或接受高风险产品或服务的；
- （三） 中国证监会、中国期货业协会和经营机构认为必要的其他投资者。

第五十一条 回访的内容包括但不限于：

- （一） 受访人是否为投资者本人或者本机构；
- （二） 受访人是否亲自填写了相关信息表格、问卷，并按要求签字或者盖章；
- （三） 受访人此前提提供的信息是否发生重要变化；
- （四） 受访人是否已知晓风险揭示或者警示的内容；
- （五） 受访人是否已知晓风险承受能力应当与所购买的产品或者服务相匹配；
- （六） 受访人是否知晓可能承担的费用及相关投资损失；
- （七） 经营机构及其工作人员是否存在《证券期货投资者适当性管理办法》第二十二条禁止

的行为；

- （八） 中国证监会、中国期货业协会和经营机构认为必要的其他内容。

第十章 投资者适当性的持续管理

第五十二条 投资者评估数据、适当性材料影像资料、录音录像文件及历史数据记录等投资者适当性相关资料统一由信息技术管理部管理，建立投资者适当性数据库。

第五十三条 资产管理部利用投资者评估数据库及交易行为记录等信息，持续跟踪和评估投资者风险承受能力，需要调整投资者风险承受能力等级的，业务单位联系投资者，并将调整后的风险承受能力评估结果交投资者签署确认，并以书面方式记载留存。

投资者在后续评估中出现风险等级降低、无法联系客户、客户拒绝对评估结果签字确定等问题，业务单位不接受投资者申购申请，但投资者可以继续持有已购买资管产品份额至产品终止，或提前赎回。

第五十四条 资产管理部每年至少开展一次适当性培训，提高相关岗位工作人员的适当性管理知识和技能，不断提升适当性执业规范水平。

第五十五条 资产管理部、各业务单位开户人员应妥善保存与履行投资者适当性职责相关的信息和资料，包括但不限于匹配方案、告知警示资料、录音录像资料等，配合中国证监会及其派出机

构和自律组织的检查，保存期限不得少于 20 年。

第五十六条 各业务单位相关人员应当对履行投资者适当性工作职责过程中所获取的投资者信息、投资者风险承受能力评级结果等信息和资料严格保密，防止该等信息和资料被泄露或被不当利用。

第五十七条 资产管理部将按照《海通期货股份有限公司客户投诉处理办法》，妥善处理因履行投资者适当性职责引起的投诉，保存投诉情况及处理记录。投资者提出调解的，各业务单位应积极配合，优先通过协商解决争议。

第十一章 附则

第五十八条 业务单位在开展资管业务过程中应当严格遵守本细则的各项规定，严格防范和控制风险。

第五十九条 本细则由资产管理部负责解释和修订。

第六十条 本细则自发布之日起实施。2020 年 9 月 21 日印发的《海通期货股份有限公司资产管理业务投资者适当性管理办法细则（试行）》同时废止。

附件：

1. 海通期货投资者基本信息表》
2. 海通期货专业投资者告知及确认书
3. 海通期货专业投资者申请书
4. 海通期货投资者风险承受能力调查问卷
5. 海通期货普通投资者适当性匹配意见告知书
6. 海通期货普通投资者转化为专业投资者申请书
7. 海通期货专业投资者转化为普通投资者确认书
8. 海通期货普通投资者购买高风险等级产品的风险警示书
9. 海通期货产品或服务风险等级名录
10. 普通投资者适当性签署材料清单
11. 专业投资者认定材料清单

附件 1.1:
海通期货投资者基本信息表（自然人）

姓名		资金		性别	男 ☐ 女 ☐	出生年	年 月	国家/	
证件类		证件				有效期	年 月 日 至 年 月		
联系电	区号	电话	手机			传真号码			
E-MAIL						学历			
有效联						邮政编码			
职业	1、党政机关负责人及管理人员 ☐ 2、企事业单位负责人及管理人员 ☐ 3、民主党派和工商联负责人及管理人员 ☐ 4、人民团体或群众团体负责人及管理人员 ☐ 5、社会组织（社会团体、基金会、社会服务机构、外国商会等）负责人及管理人员 ☐ 6、科学研究及教学人员 ☐ 7、文学艺术、体育专业人员 ☐ 8、新闻出版、文化专业人员 ☐ 9、卫生专业技术人员 ☐ 10、工程、农业专业人员 ☐ 11、法律、会计、审计、税务专业人员 ☐ 12、证券从业人员 ☐ 13、经济和金融专业人员 ☐ 14、宗教人士等特殊职业人员 ☐ 15、其他专业技术人员 ☐ 16、党政机关、企事业单位行政工作人员 ☐ 17、民主党派、工商联、人民团体或社会组织等单位工作人员 ☐ 18、人民警察、消防、应急救援人员 ☐ 19、批发与零售服务人员 ☐ 20、房地产服务人员 ☐ 21、旅游、住宿和餐饮服务人员 ☐ 22、珠宝、黄金等贵金属行业服务人员 ☐ 23、文化、体育和娱乐服务人员 ☐ 24、典当、拍卖行业服务人员 ☐ 25、艺术品或文物收藏行业服务人员 ☐ 26、废品、旧货回收服务人员 ☐ 27、交通运输、仓储、邮政业服务人员 ☐ 28、信息运输、软件和信息技术服务人员 ☐								
诚信记录	是否有来源于以下机构的 不良诚信记录 ？ 中国人民银行征信中心 ☐ 最高人民法院失信被执行人名单 ☐ 工商行政管理机构 ☐ 税务管理机构 ☐ 监管机构、自律组织 ☐ 投资者在期货经营机构从事投资活动时产生的违约失信行为记录 ☐ 法院裁判文书网不良行为信息 ☐ 其他组织 ☐ 不良诚信记录 ☐								
是否存在实际控制关系	否 ☐ 是 ☐		交易的实际受益		本人 ☐ 其他 ☐ _____				
参与期货的主要交易类	投机 ☐ 套利 ☐ 套保 ☐ 产品 ☐					是否具有完全民事行为能力			
税收居民身份:	☐ 仅为中国税收居民 ☐ 仅为非居民 ☐ 既是中国税收居民又是其他国家（地区）税收居民								
政要人物关系:	☐ 无关系 ☐ 外国政要 ☐ 外国政要家庭成员 ☐ 与外国政要关系密切								

投资目标	投资期限	0 年-1 年 ☐ 1 年-5 年 ☐ 5 年以上 ☐
	投资品种	期货 ☐ 期权 ☐ 资管产品 ☐ 其他 ☐
	期望收益	稳健 ☐ 成长 ☐ 激进 ☐

声明：

1. 本人承诺以上填写内容和授权事项均属实，如因以上提供的信息不真实、不准确、不完整的而产生的风险和后果，全部由本人承担；如上述内容发生变更将及时通知贵公司，如因未能及时完成告知由此产生的后果将由本人承担。

2. 本人有能力承担因参与资管产品或期货交易等而产生的风险，并保证参与交易资金来源的合法性和所提供资料的真实性。

承诺遵守证券、期货交易所等的各项业务规则，自愿承担资管产品或期货交易结果。

投资者（签章）：

日期： 年 月 日

*证件类型，指合法有效的身份证明文件。

附件 1.2

海通期货投资者基本信息表（机构）

单位全称			资金账号		
单位性质、资质			营业执照		
经营范围					
实际受益人			控股股东或实际控制人		
投资者类型	工业 ☐ 农业 ☐ 商业贸易 ☐ 多元化集团公司 ☐ 房地产 ☐ 投资、咨询公司 ☐ 财务公司 ☐ 信托 ☐ 保险公司 ☐ 证券集合理财 ☐ 证券自营 ☐ 基金专户理财 ☐ 封闭式基金 ☐ QFII ☐ 但未基金 ☐ 证券资产管理 ☐ 开放式基金（不包括 ETF） ☐ ETF 基金 ☐ 企业年金 ☐ 社保基金 ☐ 银行白				
诚信纪录	是否有来源于以下机构的不良诚信记录？ 中国人民银行征信中心 ☐ 最高人民法院失信被执行人名单 ☐ 工商行政管理机构 ☐ 税务管理机构 ☐ 监管机构、自律组织 ☐ 投资者在期货经营机构从事投资活动时产生的违约失信				
法定代表人		证件类型		证件号	
传真号码		联系电话	区号	电话	手机
经办人		证件类型		证件号码	
传真号码		联系电话	区号	电话	手机
注册地址					
办公地址					
所属行业是否与期货交易品种有	有 ☐ 无 ☐	参与期货的主要交易		投机 ☐ 套利 ☐ 套保 ☐ 产品 ☐	
资金来源	自有 ☐ 其他 ☐		是否存在实际控制关		是 ☐ 否 ☐
投资目标	投资期限	0 年-1 年 ☐ 1 年-5 年 ☐ 5 年以上 ☐			
	投资品种	期货 ☐ 期权 ☐ 资管产品 ☐ 其他 ☐			
	期望收益	稳健 ☐ 成长 ☐ 激进 ☐			

声明：

1. 本机构承诺以上填写内容和授权事项均属实，如因以上提供的信息不真实、不准确、不完整的而产生的风险和后果，全部由本机构承担；如上述内容发生变更将及时通知贵公司，如因未能及时完成告知由此产生的后果将由本机构承担。
2. 本机构有能力承担因参与资管产品或期货交易等而产生的风险，并保证参与交易资金来源的合法性和所提供资料的真实性。承诺遵守证券、期货交易所等的各项业务规则，自愿承担资管产品或期货交易结果。

法定代表人（负责人）/或开户代理人（签章）：

单位盖章：

日期： 年 月 日

附件 1.2.1

海通期货投资者基本信息表（产品专项表）

产品名称			
产品类型		产品备案机构	
成立时间		备案时间	
产品备案编号		产品存续期	
产品结构类别		产品规模（万元）	
产品管理人			
产品托管人			
法定代表人（负责人）/或开户代理人（签章）： 单位盖章： 日期： 年 月 日			

备注：私募基金产品为投资者时，填写《海通期货投资者基本信息表（机构）》并同时填写《海通期货投资者基本信息表（产品专项表）》

附件 2

海通期货专业投资者告知及确认书

经营 机构 告知 栏	尊敬的投资者（投资者姓名/名称： 身份证明文件号码： 资金账号： ）： 根据您的申请及财产状况、投资经验等相关证明材料,经审慎评估，您被认定为专业投资者。现将有关事项告知如下： 一、经营机构在向专业投资者销售产品或提供服务时，对专业投资者履行的适当性职责区别于普通投资者，普通投资者在信息告知、风险警示、适当性匹配等方面享有特别保护。 二、专业投资者具备必要的投资知识和经验，自行做出投资决定并自主承担投资风险。 三、当您提供的财产状况、交易情况、工作经历等信息发生重大变化时，请及时通知我公司，经复核如不再符合专业投资者的申请条件，将不再被认定为专业投资者。 海通期货股份有限公司（签章）： 日期： 年 月 日
客 投资 者确 认栏	投资者确认： 本人（机构）自愿申请被认定为专业投资者，已阅读了上述告知内容，确认相关申请资料真实、准确、完整，并知悉贵公司根据申请资料将本人（机构）认定为专业投资者。对于贵公司销售的产品或者提供的服务，本人（机构）具有必要的投资知识和经验，能够自行进行专业判断，并自主承担投资风险。 本人（机构）确认已了解贵公司对专业投资者和普通投资者在履行适当性职责方面的区别，本人（机构）知悉可以自愿申请或因不再符合专业投资者的条件，而不再被认定为专业投资者的规则。 投资者（自然人签名/机构签章、授权代表人签名）： 日期： 年 月 日

附件 3

海通期货专业投资者申请书

投资者 申 请 栏	投资者姓名/名称		资金账号	
	身份证明文件类别		身份证明文件号码	
	本人（机构）自愿申请成为专业投资者，已按要求提供财产状况、投资经历、从业经历等相关证明材料，承诺所提供材料真实、准确、完整，并符合下述相应类别的各项要求。 特此申请。 投资者（自然人签名/机构签章、授权代表人签名）： 日期： 年 月 日			
经营 机构 复 核 栏	类型	复核内容		是否符合
	机构	最近 1 年末净资产不低于 2000 万元人民币		☐ 是 ☐ 否
		最近 1 年末金融资产不低于 1000 万元人民币		☐ 是 ☐ 否
		具有 2 年及以上从事证券、基金、期货、黄金、外汇等投资经历		☐ 是 ☐ 否
	自然人	金融类资产不低于 500 万元人民币，或者最近 3 年个人年均收入不低于 50 万元		☐ 是 ☐ 否
具有 2 年及以上从事证券、基金、期货、黄金、外汇等投资经历，或者具有 2 年以上金融产品设计、投资、风险管理及相关工作经历，或者属于《办法》第八条第一项规定的专业投资者的高级管理人员、获得职业资格认证的从事金融相关业务的注册会计师和律师		☐ 是 ☐ 否		

	分支机构初审人评估意见： 资产管理部复核人评估意见： 初审人：复核人： 日期： 年 月 日 日期： 年 月 日
--	--



海通期货普通投资者风险承受能力评估问卷

投资者姓名: _____ 资金账号: _____

本问卷旨在了解您可承受的风险程度等情况，借此协助您选择合适的金融产品或金融服务类别，以符合您的风险承受能力。

风险承受能力评估是本公司向投资者履行适当性职责的一个环节，其目的是使本公司所提供的金融产品或者金融服务与您的风险承受能力等级相匹配。

本公司特别提醒您：本公司向投资者履行风险承受能力评估等适当性职责，并不能取代您自己的投资判断，也不会降低金融产品或者金融服务的固有风险。同时，与金融产品或者金融服务相关的投资风险、履约责任以及费用等将由您自行承担。

本公司提示您：本公司根据您提供的信息对您进行风险承受能力评估，开展适当性工作。您应当如实提供相关信息及证明材料，并对所提供的信息和证明材料的真实性、准确性、完整性负责。

当您的各项状况发生重大变化时，需对您所投资的金融产品及时进行重新审视，以确保您的投资决定与您可承受的投资风险程度等实际情况一致。

本公司在此承诺：对于您在本问卷中所提供的一切信息，本公司将严格按照法律法规要求承担保密义务。除法律法规规定的有权机关依法定程序进行查询以外，本公司保证不会将涉及您的任何信息提供、泄露给任何第三方，或者将相关信息用于违法、不当用途。

1	2	3	4	5	6	7	8	9	10	11	12
13	14	15	16	17	18	总分:					

一、财务状况

1. 您目前的主要收入来源是：

- A. 工资、劳务报酬
- B. 生产经营所得
- C. 利息、股息、转让证券等金融性资产收入
- D. 出租、出售房地产等非金融性资产收入
- E. 无收入来源，生活主要依靠积蓄或社会保障

2. 您最近三年个人年均收入为：

- A. 不超过 5 万元人民币
- B. 5 万-20 万元（不含）人民币
- C. 20 万-70 万元（不含）人民币
- D. 70 万元人民币以上

3. 最近您家庭预计进行金融投资的资金占家庭现有总资产（不含自住、自用房产及汽车等固定资产）的比例是：

- A. 70%以上
- B. 50%-70%
- C. 30%-50%
- D. 10%-30%
- E. 10%以下

4. 您是否有尚未清偿的数额较大的债务，如有，其性质是：

- A. 没有
- B. 有，住房抵押贷款等长期定额债务
- C. 有，信用卡欠款、消费信贷等短期信用债务
- D. 有，亲朋之间借款

5. 您可用于投资的资产数额（包括金融资产和不动产）为：

- A. 不超过 5 万人民币
- B. 5 万-50 万（不含）人民币
- C. 50 万-300 万元（不含）人民币

D. 300 万元人民币以上

二、投资知识

6. 您的投资知识可描述为：

- A. 有限：基本没有证券期货等金融投资知识
- B. 一般：对证券期货等金融产品及相关风险具有基本的知识和理解
- C. 丰富：对证券期货等金融产品及相关风险具有丰富的知识和理解
- D. 非常丰富：具有专业的证券期货等金融产品及相关风险知识，且理解深入

三、投资经验

7. 您的投资经验可以被概括为：

- A. 除银行活期和定期存款外，我基本没有其他投资经验
- B. 除银行活期和定期存款外，我购买过基金、保险等理财产品，但还需要进一步的指导
- C. 我是一位有经验的投资者，参与过股票、基金等产品的交易，并倾向于自己做出投资决策
- D. 我是一位非常有经验的投资者，参与过权证、期货或创业板等产品的交易

8. 有一位投资者一个月内做了 15 笔交易（同一品种买卖各一次算一笔），我认为这样的交易频率：

- A. 太高了
- B. 偏高
- C. 正常
- D. 偏低

9. 过去一年时间内，您购买的金融产品或接受的金融服务（含同一类型的不同产品或服务）的数量是：

- A. 5 个以下
- B. 6 至 10 个
- C. 11 至 15 个
- D. 16 个以上

10. 如果您曾经从事过金融市场投资，在交易较为活跃的月份，平均月交易额大概是多少：

- A. 10 万元以内
- B. 10 万元-30 万元
- C. 30 万元-100 万元

- D. 100 万元以上
- E. 从未从事过金融市场投资

11. 您的投资年限为：

- A. 1 年以下
- B. 1-5 年
- C. 5-10 年
- D. 10 年以上

四、投资目标

12. 您用于期货、资管产品及相关金融投资的大部分资金不会用作其它用途的时间段为：

- A. 0 到 1 年
- B. 1 到 5 年；
- C. 无特别要求

13. 您打算重点投资于哪些种类的投资品种？

- A. 债券、货币市场基金、债券基金等固定收益类投资品种
- B. 股票、混合型基金、偏股型基金、股票型基金等权益类投资品种
- C. 期货
- D. 融资融券
- E. 复杂或高风险金融产品或服务
- F. 其他产品或服务

（注：本题可多选，但评分以其中最高分值选项为准。）

14. 假设有两种不同的投资：投资 A 预期获得 5% 的收益，有可能承担非常小的损失；投资 B 预期获得 20% 的收益，但有可能面临 25% 甚至更高的亏损。您将您的投资资产分配为：

- A. 全部投资于 A
- B. 大部分投资于 A
- C. 两种投资各一半
- D. 大部分投资于 B
- E. 全部投资于 B

五、风险偏好

15. 当您进行投资时，您的首要目标是：

- A. 资产保值，我不愿意承担任何投资风险
- B. 产生一定的收益，可以承担一定的投资风险
- C. 产生较多的收益，可以承担较大的投资风险
- D. 实现资产大幅增长，愿意承担很大的投资风险

16. 您认为自己能承受的最大投资损失是多少？

- A. 不愿承受任何投资损失
- B. 一定的投资损失
- C. 较大的投资损失
- D. 损失可能超过本金

六、其他信息

17. 今后五年时间内，您的父母、配偶以及未成年子女等需承担法定抚养和赡养义务的人数为：

- A. 1-2 人
- B. 3-4 人
- C. 5 人以上

18. 您家庭的就业状况是：

- A. 您与配偶均有稳定收入的工作
- B. 有配偶，其中一人有稳定收入的工作
- C. 有配偶，均没有稳定收入或者已退休
- D. 单身，但有稳定收入的工作
- E. 单身，目前暂无稳定收入的工作或者已退休

投资者签署确认

本人已经了解并愿意遵守国家有关资管业务及期货市场管理的法律、法规、规章及相关业务规则，本人在此郑重承诺以上填写的内容真实、准确、完整。若本人提供的信息发生任何重大变化，本人将及时书面通知贵公司。

投资者（签章）：

日期： 年 月 日



(适用于机构投资者)

身份证明文件号:

本公司在此承诺：对于贵单位在本问卷中所提供的一切信息，本公司将严格按照法律法规要求承担保密义务。除法律法规规定的有权机关依法定程序进行查询以外，本公司保证不会将涉及贵单位的任何信息提供、泄露给任何第三方，或者将相关信息用于违法、不当用途。

[illegible]

1. 贵单位的性质：

- A. 国有企事业单位
- B. 非上市民营企业
- C. 外资企业
- D. 上市公司

2. 贵单位的净资产规模为：

- A. 500 万元以下
- B. 500 万元-2000 万元
- C. 2000 万元-1 亿元
- D. 超过 1 亿元

3. 贵单位拟投入资管产品或期货账户资产为：

- A. 300 万元以下
- B. 300 万元-1000 万元
- C. 1000 万元-2000 万元
- D. 超过 3000 万元
- E. 目前未开立相关账户

4. 贵单位是否有尚未清偿的数额较大的债务？如有，主要是：

- A. 银行贷款
- B. 公司债券或企业债券
- C. 通过担保公司等中介机构募集的借款
- D. 民间借贷
- E. 没有数额较大的债务

5. 对于金融产品投资工作，贵单位打算配置怎样的人员力量：

- A. 一名兼职人员(包括负责人自行决策)
- B. 一名专职人员
- C. 多名兼职或专职人员，相互之间分工不明确

D. 多名兼职或专职人员，相互之间有明确分工

6. 贵单位所配置的负责金融产品投资工作的人员是否符合以下情况：

- A. 现在或此前曾从事金融、经济或财会等与金融产品投资相关的工作超过两年
- B. 已取得金融、经济或财会等与金融产品投资相关专业学士以上学位
- C. 取得证券从业资格、期货从业资格、注册会计师证书（CPA）或注册金融分析师证书（CFA）中的一项及以上
- D. 本单位所配置的人员不符合以上任何一项描述

7. 贵单位对证券期货等金融投资知识的了解可描述为：

- A. 有限：基本没有掌握证券期货等金融投资知识的人员
- B. 一般：对证券期货等金融产品及相关风险具有基本的知识和理解
- C. 丰富：对证券期货等金融产品及相关风险具有丰富的知识和理解
- D. 非常丰富：具有专业的证券期货等金融产品及相关风险知识，且理解深入的人员

8. 贵单位的投资经验可以被概括为：

- A. 除银行活期和定期存款外，基本没有其他投资经验
- B. 除银行活期和定期存款外，购买过基金、保险等理财产品，但还需要进一步的指导
- C. 本单位具有比较多的投资经验，参与过股票、基金等产品的交易，并倾向于自己做出投资决策
- D. 本单位对于投资相当有经验，参与过权证或创业板等产品的交易
- E. 本单位对于投资非常有经验，参与期货或其它复杂衍生品交易

9. 有一位投资者一个月内做了 15 笔交易（同一品种买卖各一次算一笔），贵单位认为这样的交易频率：

- A. 太高了
- B. 偏高
- C. 正常
- D. 偏低

10. 过去一年时间内，贵单位购买的不同产品或接受的不同服务（含同一类型的不同产品或服务）的数量是：

- A. 5 个以下
- B. 6 至 10 个
- C. 11 至 15 个
- D. 16 个以上

11. 如果贵单位曾经从事过金融市场投资，在交易较为活跃的月份，平均月交易额大概是多少：

- A. 100 万元以内
- B. 100 万元-300 万元
- C. 300 万元-1000 万元
- D. 1000 万元以上
- E. 从未从事过金融市场投资

12. 贵单位用于期货、资管产品及相关投资的大部分资金不会用作其它用途的时间段为：

- A. 0 到 1 年
- B. 1 到 5 年；
- C. 无特别要求

13. 贵单位进行投资的首要目标是：

- A. 尽可能保证本金安全，不在乎收益率比较低；
- B. 产生一定的收益，可以承担较大的投资风险；
- C. 产生较多的收益，可以承担一定的投资风险；
- D. 实现资产大幅增长，愿意承担很大的投资风险。

14. 贵单位打算重点投资于哪些种类的投资品种？（注：本题可多选，但评分以其中最高分值选项为准。）

- A. 债券、货币市场基金、债券基金等固定收益类投资品种
- B. 股票、混合型基金、偏股型基金、股票型基金等权益类投资品种
- C. 期货
- D. 融资融券等
- E. 复杂或高风险金融产品或服务
- F. 其他产品或服务

15. 假设有两种不同的投资：投资 A 预期获得 5% 的收益，有可能承担非常小的损失；投资 B 预期获得 20% 的收益，但有可能面临 25% 甚至更高的亏损。您将您的投资资产分配为：

- A. 全部投资于 A
- B. 大部分投资于 A
- C. 两种投资各一半

D. 大部分投资于 B

E. 全部投资于 B

16. 贵单位参与金融产品投资的主要目的是什么？

A. 闲置资金保值增值

B. 获取主营业务以外的投资收益

C. 现货套期保值、对冲风险

D. 减持已持有的股票

投资者签署确认

本机构已经了解并愿意遵守国家有关资管业务及期货市场管理的法律、法规、规章及相关业务规则，本机构在此郑重承诺以上填写的内容真实、准确、完整。若本机构提供的信息发生任何重大变化，本机构将及时书面通知贵公司。

开户代理人签名：

机构签章：

日期： 年 月 日

海通期货问卷分值区间对应表

自然人投资者问卷答案分值参考

序号	1	2	3	4	5	6	7	8	9	10	1	1	1	1	1	1	1	1
	1	2	3	4	5	6	7	8	9	10	1	2	3	4	5	6	7	8
A	6	1	2	4	0	0	1	1	2	1	0	2	2	0	0	0	6	6
B	4	2	3	2	1	2	3	2	4	3	1	4	3	1	2	2	4	4
C	2	3	4	1	2	3	4	3	5	4	2	6	4	3	3	4	1	2
D	1	4	8	0	4	4	6	4	6	6	4		5	4	6	6		3
E	0		6							0			8	6				0
F													6					
最高	6	4	8	4	4	4	6	4	6	6	4	6	8	6	6	6	6	6
最低	0	1	2	0	0	0	1	1	2	0	0	2	2	0	0	0	1	0

最高总分：100 分 最低总分：12 分

机构投资者问卷答案分值参考

序号	1	2	3	4	5	6	7	8	9	10	11	12	13	14	15	16
A	5	1	1	3	1	8	1	0	1	1	1	1	0	2	1	3
B	2	2	3	2	3	8	2	2	2	3	2	5	2	4	2	5
C	4	6	4	1	4	8	3	6	3	6	3	8	4	5	3	4
D	6	8	5	0	5	0	6	8	4	8	4		6	5	5	1
E			0	5				8			1			8	6	
F														8		
最高	6	8	5	5	5	8	6	8	4	8	4	8	6	8	6	5

最低	2	1	0	0	1	0	1	0	1	1	1	1	1	0	2	1	1
----	---	---	---	---	---	---	---	---	---	---	---	---	---	---	---	---	---

最高总分：100 分 最低总分：12 分

风险承受能力	分值区间
C1	0-15
C2	16-28
C3	29-42
C4	43-70
C5	71-100

附件 5:

海通期货普通投资者适当性匹配意见告知书

经营 机构 告知 栏	尊敬的投资者（姓名/名称： 资金账号： ）： 身份证明文件号码： ）： 根据您提供的信息及风险承受能力问卷作答情况，本公司对您的风险承受能力进行了综合评估， 评估结果及适当性匹配意见如下： ☐您是 C1 类风险承受能力投资者，适配 R1 风险等级的产品或服务； ☐您是 C2 类风险承受能力投资者，适配 R1、R2 风险等级的产品或服务； ☐您是 C3 类风险承受能力投资者，适配 R1、R2、R3 风险等级的产品或服务； ☐您是 C4 类风险承受能力投资者，适配 R1、R2、R3、R4 风险等级的产品或服务； ☐您是 C5 类风险承受能力投资者，适配 R1、R2、R3、R4、R5 风险等级的产品或服务。 您的适当性匹配意见不代表您符合相应准入条件，不表明本公司对产品或服务的风和收益做出实质性判断或保证。 本公司履行投资者适当性职责不能取代您的投资判断，不会降低产品或者服务的固有风险，也不会影响您依法应当承担的投资风险、履约责任以及费用。 请您审慎考察金融产品或服务的特征及风险，进行充分风险评估，自行做出投资决定。如您在 审慎考虑后同意本公司的评估结果，请签字以示同意。 海通期货股份有限公司（签章）： 日期： 年 月 日
---------------------	---

客 投 资 者 确 认 栏	投资者确认： 本人（机构）确认已知晓贵公司对本人（机构）的风险承受能力及适当性匹配意见的评估结果。 本人（机构）已审慎考察金融产品或服务的特征及风险，进行充分风险评估，自行做出投资决定并自主承担投资风险。若本人（机构）提供的信息发生任何重大变化，本人（机构）都会及时书面通知贵公司。以上内容系本人（机构）独立、自主、真实的意思表示，特此确认。 投资者（自然人签名/机构签章、授权代表人签名）： 日期： 年 月 日
-------------------------------------	--

附件 6:
海通期货普通投资者转化为专业投资者申请书

投资者申请栏	投资者姓名/名称		资金账号	
	身份证明文件类别		身份证明文件号码	
	本人（机构）申请由普通投资者转化为专业投资者，并确认自主承担由此产生的风险和后果。 本人（机构）已按要求提供财产状况、交易情况、从业经历等相关证明材料，并承诺所提供材料真实、准确、完整。 特此申请。 投资者（自然人签名/机构签章、授权代表人签名）： 日期： 年 月 日			
经营机构复核栏	类型	复核内容		是否符合
	机构	最近 1 年末净资产不低于 1000 万元		☐ 是 ☐ 否
		最近 1 年末金融资产不低于 500 万元		☐ 是 ☐ 否
		具有 1 年以上证券、基金、期货、黄金、外汇等投资经历		☐ 是 ☐ 否
		投资知识测试或模拟交易等		☐ 是 ☐ 否
	自然人	金融资产不低于 300 万元或者最近 3 年个人年均收入不低于 30 万元		☐ 是 ☐ 否
		具有 1 年以上证券、基金、期货、黄金、外汇等投资经历或者 1 年以上金融产品设计、投资、风险管理及相关工作经历		☐ 是 ☐ 否
		追加了解信息、投资知识测试或模拟交易等		☐ 是 ☐ 否

分支机构初审人评估意见：

资产管理部复核人评估意见：

初审人：

复核人：

日期： 年 月 日

日期： 年 月 日

附件 7:

海通期货专业投资者转化为普通投资者确认书

投资者告知栏	投资者姓名/名称		资金账号	
	身份证明文件类型		身份证明文件号码	
	本人（机构）自愿选择由专业投资者转化为普通投资者，本人（机构）已充分理解经营机构对普通投资者履行的适当性职责区别于专业投资者，普通投资者在信息告知、风险警示、适当性匹配等方面享有特别保护。本人（机构）将独立作出投资决策并自主承担投资风险。本人（机构）承诺所提供材料真实、准确、完整。 投资者（自然人签名/机构签章、授权代表人签名）： 日期： 年 月 日			
经营机构受理栏	分支机构受理人： 受理日期： 年 月 日			

附件 8:

海通期货普通投资者购买高风险等级产品或服务

风险警示书

经营 机构 告知 栏	尊敬的投资者（姓名/名称：_____ 身份证明文件号码：_____）： 您拟投资的金融产品或拟接受的金融服务属于高风险等级的产品或服务，为保护您的合法权益，我公司特向您进行如下的风险警示，请您认真阅读并签署： 您拟投资的产品或接受的服务存在本金损失可能、波动性较大、流动性变现能力较差、结构复杂、不易估值、存在跨境因素等可能构成投资风险的因素。建议您审慎考虑，进行充分的风险评估，自行做出投资决定，由此产生的后果将由您自行承担。 若您经审慎考虑后，仍坚持投资该产品，请签署下附投资者确认书。 海通期货股份有限公司（签章）： 日期： 年 月 日
---------------------	--

投资者确认栏	海通期货股份公司： 本人（机构）已认真阅读了贵公司/营业部产品或服务的相关提示，充分知晓、完全理解并同意接受上述《风险警示书》所载明的全部内容，并已充分知悉该风险等级产品或服务的特征。 本人（机构）经审慎考虑后，仍坚持投资该项产品，并愿意承担该项投资可能引起的损失和其他后果。该决定系本人（机构）独立、自主、真实的意思表示，与贵公司及相关从业人员无关。 投资者（签章）： 日期： 年 月 日
--------	---

附件 9:

海通期货产品或服务风险等级名录

为有效指导期货经营机构对产品及服务进行风险分级，依据《证券期货投资者适当性管理办法》第三十六条规定，制定本名录。

期货经营机构可以参考本名录细化产品及服务的风险等级评价标准，期货经营机构评估相关产品及服务的风
险等级不得低于本名录规定的风险等级。期货经营机构资产管理计划的分级参考监管部门及相关产品备案机构标
准；

基金产品或者服务风险等级划分参考标准

产品或服务风险等级名录	
风险等级	产品参考因素
R1	产品结构简单，过往业绩及净值的历史波动率低，投资标的流动性很好、不含衍生品，估值政策清晰，杠杆不超过监管部门规定的标准
R2	产品结构简单，过往业绩及净值的历史波动率较低，投资标的流动性好、投资衍生品以套期保值为目的，估值政策清晰，杠杆不超过监管部门规定的标准
R3	产品结构较简单，过往业绩及净值的历史波动率较高，投资标的流动性较好、投资衍生品以对冲为目的，估值政策清晰，杠杆不超过监管部门规定的标准
R4	产品结构较复杂，过往业绩及净值的历史波动率高，投资标的流动性较差，估值政策较清晰，一倍（不含）以上至三倍（不含）以下杠杆
R5	产品结构复杂，过往业绩及净值的历史波动率很高，投资标的流动性差，估值政策不清晰，三倍（含）以上杠杆。

附件 10:

普通投资者适当性签署材料及要求

业务类型	适当性新增材料	告知，警示内容 (话术模板)	留痕	备注
认购期货资管产品	自然人投资者： 《海通期货投资者基本信息表》（见附件 1.1） 《海通期货普通投资者风险承受能力评估问卷》（见附件 4.1） 《海通期货普通投资者适当性匹配意见告知书》（见附件 5） 《海通期货个人税收居民身份声明文件》 机构投资者： 《海通期货投资者基本信息表》（见附件 1.2） 《海通期货普通投资者风险承受能力评估问卷》（见附件 4.2） 《海通期货普通投资者适当性匹配意见告知书》（见附件 5） 《海通期货机构投资者授权委托书》 《海通期货机构税收居民身份声明文件》及《海通期货控制人税收居民身份声明文件》	期货资管产品风险揭示与告知、签署适当性材料	双录	临柜
专业投资者转普通投资者	《海通期货专业投资者转化为普通投资者确认书》（见附件 7） 《海通期货普通投资者风险承受能力评估问卷》（见附件 4.1） 《海通期货普通投资者适当性匹配意见告知书》（见附件 5）	风险揭示与告知、签署适当性材料	双录	临柜

投资者信息变化及产品服务变化	1. 《海通期货普通投资者风险承受能力评估问卷》（见附件 4） 2. 《海通期货普通投资者适当性匹配意见告知书》（见附件 5）	告知变化情况及对应的风险内容、签署适当性材料	双录	临柜
购买公司高风险产品及服务	1. 《海通期货投资者基本信息表》（见附件 1） 2. 《海通期货普通投资者风险承受能力评估问卷》（见附件 4） 3. 《海通期货普通投资者适当性匹配意见告知书》（见附件 5） 4. 《海通期货普通投资者购买高风险等级产品或服务风险警示书》（见附件 8） 5. 自然人：《海通期货个人税收居民身份声明文件》 机构：《海通期货机构税收居民身份声明文件》及《海通期货控制人税收居民身份声明文件》	购买对应产品及服务的风险揭示及告知、签署适当性材料	双录	临柜

注：自然人投资者的适当性表单为本人签署，机构投资者的适当性表单为授权开户代理人签署。

附件 11:

专业投资者认定材料及要求

投资者类型		适当性新增材料	告知，警示内容 (话术模板)	留痕
购买资 管产品	自然人	1. 《海通期货投资者基本信息表》（见附件 1.1） 2. 《海通期货专业投资者申请书》（见附件 3） 3. 《海通期货专业投资者告知及确认书》（见附件 2） 4. 《海通期货个人税收居民身份声明文件》 5. 近一个月金融资产不低于 500 万元，或者最近 3 年个人年均收入不低于 50 万元； 6. 具有 2 年以上证券、基金、期货、黄金、外汇等投资经历，或者具有 2 年以上金融产品 设计、投资、风险管理及相关工作经历，或者属于《办法》第八条第（一）项规定的 专业投资者的高级管理人员、获得职业资格认证的从事金融相关业务的注册会计师和律 师。	—	—

	一般单位	1. 《海通期货投资者基本信息表》（见附件 1.1） 2. 《海通期货专业投资者申请书》（见附件 3） 3. 《海通期货专业投资者告知及确认书》（见附件 2） 4. 《海通期货机构投资者授权委托书》 5. 《海通期货机构税收居民身份声明文件》及《海通期货控制人税收居民身份声明文件》 6. 最近 1 年末净资产不低于 2000 万元； 7. 最近 1 年末金融资产不低于 1000 万元； 8. 具有 2 年以上证券、基金、期货、黄金、外汇等投资经历。	--	—
	特殊法人	1. 《海通期货投资者基本信息表》（见附件 1.2） 2. 《海通期货专业投资者告知及确认书》（见附件 2） 3. 《海通期货机构投资者授权委托书》 4. 《海通期货机构税收居民身份声明文件》及《海通期货控制人税收居民身份声明文件》	--	—

普通投资者转	自然人	1. 《海通期货普通投资者转化为专业投资者申请书》（见附件 6） 2. 《海通期货专业投资者告知及确认书》（见附件 2） 3. 近一个月金融资产不低于 300 万元或者最近 3 年个人年均收入不低于 30 万元； 4. 具有 1 年以上证券基金、期货、黄金、外汇等投资经历或者 1 年以上金融产品设计、投资、风险管理及相关工作经历； 5. 提供其他相关信息、投资知识测试或者模拟交易经历等。	警示可能承担的投资 风险、签署适当性材料	双录
专业投资者	一般单位	1. 《海通期货普通投资者转化为专业投资者申请书》（见附件 6） 2. 《海通期货专业投资者告知及确认书》（见附件 2） 3. 最近 1 年末净资产不低于 1000 万元，最近 1 年末金融资产不低于 500 万元； 4. 且具有 1 年以上证券、基金、期货、黄金、外汇等投资经历的除专业投资者外的法人或其他组织； 5. 提供其他相关信息、投资知识测试或者模拟交易经历等。	警示可能承担的投资 风险、签署适当性材料	双录

注：自然人投资者的适当性表单为本人签署，机构投资者适当性表单为授权开户代理人签署