

关于发布《郑州商品交易所期货交易者适当性制度操作指引》的通知

郑商函〔2019〕213号

各会员单位：

为进一步明确期货交易者适当性制度操作要求，根据《郑州商品交易所期货交易细则》《郑州商品交易所期货交易者适当性管理办法》及其他相关规定，我所制定了《郑州商品交易所期货交易者适当性制度操作指引》，现予发布，自发布之日起施行。原《郑州商品交易所期权投资者适当性制度操作指引》与《郑州商品交易所特定品种交易者适当性制度操作指引》同时废止。

特此通知。

附件：郑州商品交易所期货交易者适当性制度操作指引

郑州商品交易所

2019年5月31日

附 件

郑州商品交易所期货交易者适当性 制度操作指引

为进一步明确郑州商品交易所（以下简称交易所）期货交易者适当性制度操作要求，指导期货公司会员、境外经纪机构（以下统称开户机构）落实期货交易者适当性制度，根据《郑州商品交易所期货交易细则》《郑州商品交易所期货交易者适当性管理办法》（以下简称《办法》）及其他相关规定，制定本指引。

一、交易权限管理要求

（一）交易编码实行权限管理。期货公司会员可以为通过适当性评估或者符合适当性评估豁免条件的境外客户申请交易编码，境外客户获得交易编码后，期货公司会员应开通其特定品种期货合约和特定品种期权合约交易权限，关闭其他品种交易权限；境内客户开户后，期货公司会员应先关闭其期权合约和特定品种期货合约的交易权限，通过适当性评估或者符合适当性评估豁免条件的，开户机构应当按照客户意愿，开通期权合约或特定品种期货合约的交易权限。

（二）符合条件的客户可以向开户机构提出申请，新增或者关闭上市品种交易权限。

二、基础知识要求

单位客户的相关业务人员和个人客户本人应当具备期货交易基础知识，了解交易所相关业务规则。开户机构可以通过下述方式了解客户知识水平：

（一）知识测试。客户通过中国期货业协会的期货投资者适当性知识测试平台进行在线知识测试，知识测试总分100分，得分80分为合格。知识测试应当由单位客户的指定下单人或者个人客户本人全程独立自主完成，不得由他人代替。

（二）承诺函。境外客户可以通过出具承诺函的方式，表明其具有《办法》所要求的知识水平，同时承担提供不实承诺的后果。承诺函应当注明境外单位客户的相关业务人员或者个人客户本人具备期货交易基础知识，了解相关业务规则。

三、交易经历要求

（一）关于仿真交易经历。客户应当提供由证券公司、期货公司等机构出具的境内交易场所联调测试系统、仿真系统的期货合约或者期权合约的交易结算单等单据，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。

（二）关于境内交易经历。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）的境内交易场所期货合约、期权合约或者集中清算的其他衍生品交易（如掉期交易）的成交记录。

（三）关于境外交易经历。客户应当提供在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）的期货合约、期权合约或者集中清算的其他衍生品交易（如掉期交易）的成交记录（以下简称认可境外成交记录）。

（四）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。

四、可用资金余额要求

（一）客户保证金账户可用资金余额以开户机构收取的保证金作为计算依据。境外客户可以使用外汇资金作为保证金。可用资金余额包括人民币资金和外汇资金。可用外币币种和外汇充抵折扣率由交易所另行公布。

外汇资金换算为人民币资金的公式为：

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

（二）期货公司会员直接为客户申请开立交易编码或者开通交易权限的，应当确认该客户申请日前连续 5 个交易日每日结算后，在该期货公司会员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。

境外经纪机构为客户申请开立交易编码或者开通交易权限的，应当确认该客户申请日前连续5个交易日，在该境外经纪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。

五、合规诚信要求

（一）开户机构应当通过多种渠道了解客户诚信信息，结合各个国家（地区）相关征信系统，对客户的诚信状况进行综合评估。开户机构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。

（二）开户机构应当通过中国证监会证券期货市场失信信息公开查询平台、中国期货业协会行业信息管理平台以及涉金融严重失信人员名单等对客户诚信情况进行查询；若无法了解客户是否符合《办法》中合规诚信相关要求，开户机构还应当要求客户出具书面承诺表明其达到《办法》中合规诚信相关要求，并承担提供不实承诺的后果。

六、单位客户的内部制度要求

开户机构为单位客户参与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，应当确认单位客户具有健全的内部控制、风险管理等期货交易管理相关制度，如期货交易决策、期货交易下单、资金划拨、实物交割、风险管理等业务制度或者流程。

七、适当性评估豁免情形

（一）开户机构对下述情形的客户进行适当性评估时，可以不再对其基础知识、交易经历和可用资金余额进行评估：

1. 已具有境内商品期货交易所实行适当性制度的上市品种交易权限的客户；
2. 已具有金融期货交易编码的客户；
3. 已具有境内证券交易所期权交易权限的客户。

客户应当提供具有上述交易权限的证明材料。

（二）开户机构应当充分使用已了解信息和已有评估结果。已通过适当性评估获得交易所某上市品种交易权限的客户，在该开户机构自动获得交易所其他实行适当性制度的上市品种交易权限。

（三）开户机构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，可以不对其基础知识、交易经历、可用资金余额进行评估：

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；
2. 已开通实行适当性制度的某一品种交易权限的，再通过其他开户机构开通该品种交易权限的客户。客户应当提供具有该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。客户应当提供交易记录明细、结算单据或者其他凭证；

4. 做市商、特殊单位客户等交易所认可的其他交易者。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。

八、其他要求

（一）交易编码申请材料的要求适用于交易权限申请材料。开户机构应当将客户符合适当性制度要求的基础知识、交易经历、可用资金余额、合规诚信等相关证明材料及交易权限申请等相关材料作为开户资料予以保存。保存时间应当符合当地法律法规规定，除依法接受调查和检查外，应当为客户保密。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。

（二）客户开通期权合约或特定品种期货合约交易权限后 3 个交易日内，开户机构应当按规定向交易所报备开通交易权限的交易编码。因客户销户或者不再符合适当性要求而关闭相关交易权限的，开户机构应当在 3 个交易日内撤销报备。

（三）开户机构已有资料能够显示客户具有相关成交记录的，可以豁免客户提供相关证明材料。

（四）客户向开户机构提出开具交易经历、交易权限等证明材料，开户机构应当根据实际情况出具相关证明。

九、附则

本指引由郑州商品交易所负责解释。