

中国金融期货交易所 交易者适当性制度操作指引

(2019 年 12 月 14 日发布)

第一章 总则

第一条 为落实金融期货交易者适当性制度，规范期货公司会员业务操作，根据《中国金融期货交易所交易者适当性制度管理办法》（以下简称《办法》）的有关规定，制定本指引。

第二章 金融期货交易者适当性标准操作要求

第一节 基础知识要求

第二条 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，了解中国金融期货交易所（以下简称交易所）相关业务规则。

第三条 期货公司会员可以通过知识测试方式了解客户知识水平。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。

第二节 交易经历要求

第四条 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仿真交易结算单等材料，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。

第五条 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。

第六条 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。

第三节 可用资金要求

第七条 客户保证金账户可用资金余额以期货公司会员收取的保证金作为计算依据。

第八条 期货公司会员为客户申请开立交易编码的，应

当确认申请日前连续 5 个交易日每日结算后，客户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。

第四节 合规诚信要求

第九条 期货公司会员应当通过多种渠道了解客户诚信信息，结合国家相关征信系统，对客户的诚信状况进行综合评估。期货公司会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。

第十条 期货公司会员应当通过中国证监会证券期货市场违法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等对客户诚信情况进行查询。期货公司会员还可以要求客户出具书面承诺，表明其符合《办法》中合规诚信相关要求，同时承担提供不实承诺的后果。

第五节 单位客户的内部制度要求

第十一条 单位客户申请开立交易编码的，应当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、风险管理等业务制度或者流程。

第三章 其他要求

第十二条 期货公司会员依据《办法》第六条、第七条，对客户不适用部分适当性评估标准的，应当要求其提供符合条件的证明材料。

第十三条 客户向期货公司会员提出开具交易经历、交易权限等证明材料的，期货公司会员应当根据实际情况出具相关证明。

第十四条 期货公司会员应当将客户符合适当性制度基础知识、交易经历、可用资金、合规诚信等要求的证明材料作为开户资料予以保存。

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。

第四章 附则

第十五条 本指引由交易所负责解释。

第十六条 本指引自 2019 年 12 月 23 日起实施。