附件

上海国际能源交易中心期货交易者

适当性制度操作指南

（暂行）

为进一步明确期货交易者适当性制度的操作要求，根据《上海国际能源交易中心交易规则》、《上海国际能源交易中心期货交易者适当性管理细则》等有关规定，制定本指南。

一、本指南适用范围

期货公司会员、境外特殊经纪参与者和境外中介机构等开户机构落实上海国际能源交易中心（以下简称能源中心）期货交易者适当性制度要求，适用本指南。

二、可用资金要求

（一）开户机构为客户向能源中心申请交易编码，应当确认该客户符合能源中心规定的可用资金余额要求。

客户保证金账户可用资金余额以开户机构收取的保证金标准作为计算依据。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：

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，外币是指能源中心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能源中心另行公布。

（二）期货公司会员为客户申请交易编码的，该客户申请日前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得低于能源中心规定的要求。

（三）境外特殊经纪参与者、境外中介机构为客户申请交易编码的，该客户申请日前5个交易日在该开户机构处的保证金账户可用资金余额均不得低于能源中心规定的要求。

对于通过适当性审核的客户，境外特殊经纪参与者、境外中介机构应当为该客户出具《关于客户符合上海国际能源交易中心期货交易者适当性制度可用资金要求的证明》（见附件1），并在申请交易编码时将该证明作为开户材料提交。

三、知识测试要求

（一）单位客户的指定下单人及个人客户本人应当参加知识测试，不得由他人替代。

（二）期货公司会员、境外特殊经纪参与者通过能源中心会员服务系统下载测试试卷；境外中介机构通过能源中心服务系统下载测试试卷。

知识测试应当由单位客户的指定下单人及个人客户本人全程独立自主完成。测试完成后，知识测试监督人员对试卷进行评分。知识测试监督人员和客户应当在测试试卷上签字。

开户机构客户开发人员不得兼任知识测试监督人员。

（三）开户机构不得为低于测试试卷合格标准的客户申请交易编码。

（四）对于未能通过测试的客户，开户机构可以加强对客户的培训和指导，并可以在继续培训后再组织其参加测试。

四、交易经历要求

开户机构为个人客户和单位客户向能源中心申请交易编码前，应当确认该客户具备能源中心要求的境内外期货交易经历或者能源中心认定的仿真期货交易经历。

**（一）关于境内期货交易经历。**客户应当提供由期货公司正式出具的期货交易结算单，以证明其最近三年内具有10笔以上（含）的期货或期权交易成交记录。

**（二）关于境外期货交易经历。**客户应当提供由境外金融机构正式出具的期货交易记录明细、结算单据或者其他凭证作为证明，以证明其最近三年内具有10笔以上（含）的期货或期权交易成交记录。

**（三）关于能源中心认定的仿真期货交易经历。**目前能源中心认定的仿真期货交易经历，是指能源中心联调仿真系统的仿真交易测试。客户的仿真交易经历应当包括累计10个交易日、10笔以上（含）的仿真交易记录。一笔委托分次成交的视为一笔成交记录。

五、合规诚信查询要求

开户机构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。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；不得为存在法律、法规、规章和能源中心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。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。

此外，开户机构可以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/>）等平台对客户诚信情况进行查询。

六、单位客户的特殊要求

单位客户申请开户，应当建立健全交易管理制度和信息通报制度，并提供加盖公章或者经法定代表人或授权人签字的证明文件。

交易管理制度，应当包括期货交易决策制度，期货交易下单、资金划拨、实物交割等业务管理制度，期货交易风险控制制度等内容。

信息通报制度，应当包括向开户机构提供和及时更新负责期货交易的部门主管人员及相关业务人员信息的机制等内容。

七、监管要求

（一）客户应当对其所提供的适当性材料的真实性、有效性负责，并出具书面承诺。

（二）开户机构应当将客户提供的证明文件及相关材料的原件或者复印件、投资者的知识测试试卷等作为开户资料予以保存，保存时间不少于20年，除依法接受调查和检查外，应当为客户保密。

（三）特殊单位客户申请能源中心交易编码的，可以不适用本指南关于可用资金要求、知识测试要求、交易经历要求的相关规定。

特殊单位客户是指证券公司、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客户。

（四）对于直接在期货公司会员处申请开户并取得能源中心有效交易编码的客户在其他期货公司会员处申请开户的，该客户可以不适用本指南中关于可用资金要求、知识测试要求、交易经历要求的相关规定。但需要客户提供原开户期货公司出具的客户已取得能源中心有效交易编码的证明。

（五）开户机构为客户申请开户时，应当遵守《上海国际能源交易中心交易细则》、《上海国际能源交易中心会员管理细则》、《上海国际能源交易中心境外特殊参与者管理细则》中关于交易编码的规定。

八、附则

（一） 本指南由能源中心负责解释。

（二） 本指南自发布之日起实施。

附：1. 关于客户符合期货交易者适当性制度可用资金要求的证明

2. 客户承诺书

附1

关于客户符合期货交易者适当性制度

可用资金要求的证明

上海国际能源交易中心：

兹证明（客户姓名/名称）***（有效身份证件号码）***满足上海国际能源交易中心期货交易者适当性制度中关于可用资金的要求，即：

* 单位客户申请交易编码前5个交易日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
* 个人客户申请交易编码前5个交易日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

开户经办人（签字）

开户业务负责人（签字或盖章）

开户机构

日期

附2

客户承诺书

本人/本公司承诺：

1. 本人/本公司所提供关于上海国际能源交易中心期货交易者适当性材料真实、有效。

2. 本人/本公司不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；不存在法律、法规、规章和上海国际能源交易中心业务规则禁止或者限制从事期货交易的情形。

客户（签名或盖章）

日期