**附件1**

**上海国际能源交易中心期货交易者**

**适当性制度操作指引**

为了落实特定品种期货和期权交易者适当性制度，规范期货公司会员、境外特殊经纪参与者、境外中介机构（以下统称开户机构）业务操作，根据《上海国际能源交易中心期货交易者适当性管理细则》（以下简称《细则》）及相关规定，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。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，开户机构应当按照客户意愿，开通相关品种的交易权限。

（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，了解能源中心相关业务规则。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《细则》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和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。能源中心以及境内其他交易场所联调测试系统、仿真系统的期货或者期权的仿真交易经历均为能源中心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。

（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）的期货、期权或者集中清算的其他衍生品交易（如上海清算所的掉期、互换等）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（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折算率由能源中心另行公布。

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×外汇折算率

（二）时限要求

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能源中心规定的标准。

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能源中心规定的标准。

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，结合各国相关征信系统，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。开户机构还可以要求客户出具承诺，表明其符合《细则》中合规诚信相关要求，同时承担提供不实承诺的后果。

六、单位客户的内部制度要求

单位客户申请开立交易编码或者开通交易权限的，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、实物交割、风险管理等业务制度或者流程。

七、部分或者全部不适用评估的情形

（一）所有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要求、交易经历要求进行评估。客户已参与的实行适当性制度的上市品种可用资金要求不低于新申请品种的，所有开户机构还可以不再对其可用资金要求进行评估。

1、客户已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的；

2、客户已具有金融期货交易的交易编码的；

3、客户已具有境内证券交易所期权交易权限的；

4、客户已经具有能源中心交易编码，并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的。

客户应当提供具有上述资格的证明资料。

（二）开户机构进行适当性审核时，应当充分使用已了解信息和已有评估结果，可以不对客户的相同项目重复进行适当性评估，不重复要求提供证明材料。

客户在同一开户机构申请交易能源中心不同上市品种，已获得可用资金余额较高的上市品种交易权限的，可以自动获得可用资金余额要求相同或者较低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要求、交易经历要求、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；

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。客户应当提供具有交易权限的证明资料。

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，表明该等交易确已实际成交。

4、做市商、特殊单位客户等能源中心认可的其他交易者。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、合规诚信等规定的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。

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）客户开通实行适当性制度的上市品种交易权限后3个交易日内，开户机构应当按规定向能源中心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，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。

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

（一）本指引由上海国际能源交易中心负责解释。

（二）本指引自发布之日起施行。《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）》（上能发〔2017〕15号）同时废止。