

大连商品交易所期权投资者适当性 管理办法（草案）

第一条 为保障期权市场平稳、规范、健康运行，防范风险，保护投资者的合法权益，根据《大连商品交易所交易规则》、《大连商品交易所期权交易管理办法》，制定本办法。

第二条 期货公司会员应当根据中国证券监督管理委员会（以下简称中国证监会）有关规定和本办法要求，评估投资者的期权认知水平和风险承受能力，选择适当的投资者审慎参与期权交易，执行期权投资者适当性制度各项要求。

第三条 投资者应当全面评估自身的经济实力、产品认知能力、风险控制与承受能力，审慎决定是否参与期权交易。

第四条 投资者申请开通期权交易权限，应当具有大连商品交易所（以下简称交易所）的交易编码。

第五条 期货公司会员可以为符合下列条件的个人客户开通期权交易权限：

（一）开通期权交易权限前一交易日结算后保证金账户可用资金余额不低于人民币 10 万元；

（二）具备期货、期权基础知识，通过交易所认可的知识测试；

（三）具有满足交易所要求的累计 10 个交易日、20 笔以上的期权仿真交易经历；

（四）不存在法律、行政法规、规章和交易所业务规则禁止或者限制从事期货和期权交易的情形；

（五）交易所规定的其他条件。

第六条 期货公司会员可以为符合下列条件的一般单位客户开通期权交易权限：

（一）开通期权交易权限前一交易日结算后保证金账户可用资金余额不低于人民币 10 万元；

（二）相关业务人员具备期货、期权基础知识，通过交易所认可的知识测试；

（三）具有满足交易所要求的累计10个交易日、20笔以上的期权仿真交易经历；

（四）具备参与期权交易的内部控制、风险管理等相关制度；

（五）不存在法律、行政法规、规章和交易所业务规则禁止或者限制从事期货和期权交易的情形；

（六）交易所规定的其他条件。

本办法所称一般单位客户是指除第七条所列特殊单位客户和做市商以外的单位客户。

第七条 除法律、法规、规章以及中国证监会另有规定外，期货公司会员为特殊单位客户、做市商和最近三年内具有满足交易所要求的期权真实交易经历的客户开通期权交易权限，可不对其进行投资者适当性评估。

特殊单位客户是指证券公司、基金管理公司、信托公司、银行和其他金融机构，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，以及交易所认定的其他单位客户。

第八条 交易所可以根据市场情况对投资者适当性标准进行调整。

第九条 期货公司会员应当根据中国证监会的有关规定和本办法，制定本公司的期权投资者适当性制度实施方案，建立相关工作制度，完善内部分工与业务流程，并及时向交易所报备开通期权交易权限的投资者的交易编码。

第十条 期货公司会员应当向投资者充分揭示期权风险，客观介绍期权法律法规、业务规则和产品特征，严格验证投资者资金、期权仿真交易经历和真实交易经历，测试投资者的期货、期权基础知识，审慎评估投资者的风险承受能力，认真审核投资者期权交易申请材料。

第十一条 投资者保证金账户可用资金余额以期货公司会员收取的保证金标准作为计算依据。

第十二条 投资者的期货、期权基础知识测试应当符合下列要求：

（一）投资者应当参加交易所认可的知识测试，测试分数不得低于交易所公布标准；

（二）个人客户本人及一般单位客户的指定下单人应当参加测试，不得由他人替代；

（三）期货公司会员的客户开发人员不得兼任知识测试人员；

（四）期货公司会员应当加强对投资者的培训和指导，对于未能通过测试的投资者，期货公司会员可以在继续培训

后再组织其参加测试；

（五）投资者申请开通期权交易权限，应当出具测试成绩。

第十三条 投资者的期权仿真交易或者期权真实交易成交记录证明材料，应当由期货公司会员核实并认定。一笔委托分次成交的视为一笔成交记录。

第十四条 期货公司会员为客户开通期权交易权限前，应当要求客户填写投资者期权交易申请表。申请表应当由个人客户本人签字，单位客户加盖本公司公章。期货公司会员应当按要求进行审核，由经办人签字、审核人审核（经办人和审核人不能为同一人），并加盖期货公司合法有效的印章。

第十五条 期货公司会员应当督促客户遵守与期权交易相关的法律、行政法规、规章及交易所业务规则，持续开展风险教育，加强客户交易行为的合法合规性管理。

第十六条 期货公司会员应当建立客户资料档案，妥善保存申请表、投资者保证金账户资金余额证明、知识测试材料、期权仿真交易或者期权真实交易成交记录证明材料、个人客户有效身份证明文件的复印件、单位客户办理期权交易申请的授权委托书以及受托人有效身份证明文件的复印件等相关材料，以备交易所检查。除依法接受调查和检查外，应当为客户保密。

第十七条 期货公司会员应当为客户提供合理的投诉渠道，告知投诉的方法和程序，妥善处理纠纷，督促客户依法维护自身权益。

第十八条 期货公司会员委托从事中间介绍业务的证券公司协助办理开通期权交易权限手续的，应当与证券公司建立业务对接规则，落实投资者适当性制度的相关要求，对证券公司相关业务进行复核。

第十九条 投资者应当如实申报期权交易权限开通材料，不得采取虚假申报等手段规避期权投资者适当性制度要求。

第二十条 投资者应当遵守“买卖自负”的原则，承担期权交易的责任，不得以不符合投资者适当性标准为由拒绝对期权交易结果承担责任。

第二十一条 投资者应当通过正当途径维护自身合法权益。投资者维护自身合法权益时应当遵守法律法规的相关规定，不得侵害国家、社会、集体利益和他人合法权益，不得扰乱社会公共秩序、交易所及相关单位的工作秩序。

第二十二条 交易所对期货公司会员落实投资者适当性制度相关要求的情况进行检查时，期货公司会员应当配合，如实提供投资者期权交易权限开通相关资料，不得隐瞒、阻碍和拒绝。

交易所在检查中发现从事中间介绍业务的证券公司存在违规行为的，有权进行必要的延伸检查，并将有关违规情况通报中国证监会相关派出机构。

第二十三条 违反本办法规定的，交易所按《大连商品交易所违规处理办法》的有关规定处理。

第二十四条 本办法所称“以上”，包括本数。

第二十五条 本办法由交易所负责解释。

第二十六条 本办法自公布之日起实施。