



**心中有信
未来可期**

**特殊法人投资者
期货入门手册**



中信期货官方微信



中信期货APP

总部地址

深圳市福田区中心三路8号
卓越时代广场（二期）北座13层1301-1305室、14层

上海地址

上海市浦东新区杨高南路799号陆家嘴
世纪金融广场 3号楼23层

全国热线：400-9908-826
传 真：0755-83217421
公司网址：www.citicsf.com



DISCLAIMER

免责声明

本文件由中信期货有限公司撰写，仅为所服务的特定客户、企业与机构的一般用途而准备。除非另有显示，版权归本公司所有。未经中信期货有限公司事先书面授权，任何机构和个人不得以任何形式翻版、复制、发布及分发本文件的全部或部分内容给任何其他人士。如引用发布本文件中的内容，需注明出处为中信期货有限公司，且不得对本文件进行有悖原意的引用、删节和修改。

本公司特别提示投资者：本公司履行投资者适当性管理职责，根据投资者提供的信息对投资者进行风险承受能力评估，开展适当性工作。投资者应当如实提供相关信息及证明材料，并对所提供的信息和证明材料的真实性、准确性、完整性负责。投资者应综合考虑自身风险承受能力与公司提出的适当性匹配意见，独立做出投资决策并承担投资风险；公司提出的适当性匹配意见不表明其对产品或服务的风险和收益做出实质性判断或者保证，并不能取代投资者的投资判断，也不会降低产品或服务的固有风险。与产品或服务相关的投资风险、履约责任以及费用等将由投资者自行承担。

本文件所载的内容只提供给阁下作查照之用。本文件的内容并不构成对任何人的投资建议，且本公司不会因接收人收到此文件而视其为本公司客户。本文件所引用的信息和数据均来自于公开资料及其他合法渠道，本公司力求文件内容、引用资料和数据客观与公正，尽可能保证可靠、准确和完整，但并不能担保文件所述信息的准确性和完整性，本公司将根据公司发展情况随时补充和修订有关信息，但不保证及时发布。本公司不对因使用此文件材料而引致的损失负任何责任。

本文件中所提供的信息仅供参考，不能作为投资决策的依据，阁下并不能依靠此文件取代行使独立判断。对于本文件所提供的信息所导致的任何直接或者间接的投资盈亏后果，本公司不承担任何经济与法律责任。

《特殊法人投资者期货入门手册》（第一版）由中信期货有限公司版权所有，保留一切权利。

前言

本指引所称**特殊法人投资者**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。

开户指引

1、开户要求

一般要求

- （1）客户应是具备从事期货交易主体资格的法人或其他经纪组织；
- （2）客户须以真实的、合法的身份开户；
- （3）客户须保证资金来源的合法性；
- （4）特殊法人客户须提供《企业法人营业执照》，客户需保证所提供资料的真实性、合法性、有效性；
- （5）特殊法人客户可由法定代表本人/合伙企业的执行事务合伙人或委托开户代理人办理开户手续，非法定代表人须持加盖单位公章的授权委托书；
- （6）开户时实时采集并由期货公司保存投资者的影像资料；
- （7）国家法律、行政法规规定的其它要求或条件。

相关特殊要求

特殊单位类型	开户条件
证券自营	具备独立法人资格，经中国证券监督管理委员会（以下简称中国证监会）批准成立的证券公司，可向交易所申请交易编码。证券公司可以为其从事自营业务的部门或者团队分别向交易所申请交易编码。
证券定向	具有独立法人资格，经中国证监会批准取得证券资产管理业务资格的证券公司，可为其定向资产管理计划向交易所申请交易编码。
证券集合	具有独立法人资格，经中国证监会批准取得证券资产管理业务资格的证券公司，可为其集合资产管理计划向交易所申请交易编码。

证券公司基金 管理业务	具有独立法人资格，经中国证监会批准取得证券投资基金管理业务资格的证券公司，可为其基金产品向交易所申请交易编码。
基金管理公司及其 子公司：特定客户 证券投资产品	具有独立法人资格，经中国证监会批准取得特定客户资产管理业务资格的基金管理公司，可为其特定客户资产管理产品向交易所申请交易编码。基金管理公司子公司开展特定客户资产管理业务，参照本项规定执行。
基金管理公司及其 子公司：证券投资 基金	具有独立法人资格，符合中国证监会相关监管要求的证券投资基金，可为其证券投资基金产品向交易所申请交易编码。
集合信托产 品	具有独立法人资格，经中国银监会批准取得股指期货交易业务资格的信托公司，可为其信托产品向交易所申请交易编码。
单一信托产 品	具有独立法人资格，经中国银监会批准取得股指期货交易业务资格的信托公司，可为其信托产品向交易所申请交易编码。
保险机构资 产组合	具有独立法人资格，并在中国保监会完成股指期货业务备案的保险机构，可为每一确定的资产组合向交易所申请开立交易编码。
保险机构基 金管理业务	具有独立法人资格，并在中国保监会完成股指期货业务备案的保险机构，可为每一确定的保险机构基金产品向交易所申请开立交易编码。
QFII	经中国证监会批准取得证券投资业务许可，并持有国家外汇管理局颁发的外汇登记证的合格境外机构，根据有关规定可为每一个用作股指期货交易的人民币账户向交易所申请开立交易编码。
人民币合格境外机 构投资者（RQFII）	经中国证监会批准取得证券投资业务许可，并持有国家外汇管理局颁发的外汇登记证的人民币合格境外机构，根据有关规定可为每一个用作股指期货交易的人民币账户向交易所申请开立交易编码。
私募基金产品	在中国证券投资基金业协会完成私募基金管理人登记和私募基金备案的公司或者合伙企业，可为每一备案私募基金向交易所申请开立交易编码。或期货公司资产管理子公司。
期货公司风险管 理子公司	在中国期货业协会完成备案的期货公司风险管理子公司，可以为其开展合作套保业务的个人和单位申请编码。
做市商	期货市场做市商

2、开户方式

线下办理开户(可视客户情况提供临柜办理和见证办理两种方式)。

3、开户所需提供的基本资料(最新的开户资料清单和表单请开户前联系我们)

- (1) 提供三证合一的《企业法人营业执照》原件扫描件及复印件；
- (2) 开户代理人头部正面照、身份证原件扫描件及复印件；
- (3) 法定代表人及被授权人（如有）身份证明文件复印件；
- (4) 代理人授权委托书；
- (5) 公司章程
- (6) 银行开户许可证
- (7) 提供相关监管机构或主管机关的批准文件及其他开户需要提供的材料。

4、线下开户流程

- 1 | 具有独立法人资格，经中国银监会批准取得股指期货交易业务资格的信托公司，可为其信托产品向交易所申请交易编码。
- 2 | 签署三方协议（提前确认是否有参考模板或是否有签过总对总的三方协议）
- 3 | 按照开户资料清单准备开户材料（如着急申请套保额度可同时准备套保额度申请材料）
- 4 | 提交给期货运营岗审核开户资料、资料无误后签字用印、办理见证开户
- 5 | 开户岗二次复核资料、系统录入开户、开通交易编码（资料完整无误的情况下一般1个工作日内左右可完成开户）
- 6 | 发送密码邮件和开户回执（一般盘后发送）
- 7 | 修改密码、办理银期关联（联系托管行；如需修改银期关联的证件类型请联系我们）
- 8 | 入金交易

5、期货账户密码

(1) 交易密码：交易软件登录时使用，开户时由开户代理人设置或授权公司开户人员设置，首次登录软件需修改为8位（含）以上的新密码；

(2) 资金密码：银期转账签约和转账时使用，开户时由开户代理人设置或授权公司开户人员设置，需登录交易终端后在“修改密码”选项中具体选择修改；

 **温馨提示：**如交易和资金密码为客户授权公司开户人员设置的，将通过加密邮件形式发送客户指定邮箱。如有疑问可联系您的客户经理或致电公司客服热线。

(3) 中国期货市场监控中心投资者查询服务系统的用户名和密码：用于登录中国期货市场监控中心查询结算账单使用，用户名为0158+资金账号，密码为数字+英文字母，用户名和密码于开户成功后第二天以短信形式发给客户开户代理人。

6、其它注意事项

(1) 特殊法人投资者应根据监管要求及产品本身的投资范围和限制等审慎参与期货交易和交易相关品种。

(2) 特殊法人投资者存在多家期货公司同时开户情况的，在提交开户信息时应保证信息资料的一致性，比如附加码、交易编码名称等关键信息。

(3) 特殊法人客户以产品形式开户的，产品信息变更请及时联系我司进行报备。

(4) 产品终止或清盘请及时联系我司办理账户销户手续。

2、银期签约银行

我司已支持建设银行、交通银行、工商银行、中国银行、农业银行、中信银行、招商银行、兴业银行、光大银行、民生银行、上海浦发银行、平安银行等银行作为期货结算银行（最新信息以我司网站“银期转账”栏目公示的信息为准）。

3、银期签约所需资料

(1) 法人代表身份证原件和复印件（如非法人代表本人办理的，代理人应提供本人身份证原件及复印件，法人代表身份证复印件、法人代表授权委托书原件）

(2) 法人印鉴

(3) 营业执照副本原件及复印件（需加盖公章）

(4) 银期转账协议

 **温馨提示：**以上资料不完全概况办理该项业务所需的资料，请客户开通银期转账业务前与对接的开户银行沟通，确定具体所需的办理资料。

4、转账时间

银行转期货：交易日8:30—16:00，20:30—2:30

期货转银行：交易日9:20—16:00

5、银期转账途径

期货交易软件或银行终端（网银、柜台或电话银行等）

 **温馨提示：**因各银行对法人银期转账途径有不同的限制，具体法人客户可银期转账的实现途径可参阅公司官网-网上营业厅-客服中心-银期转账-银期转账问答：

<https://www.citicsf.com/e-futures/csc/000202>

6、银期转账出金限额

保底资金：10元

有委托交易或持仓时可取比例：90%

当日累计出金额度：1000万

 **温馨提示：**当日平仓盈利可以用于开仓不能当日转出；如您有大额转账需求可联系客户经理或拨打公司服务热线。

银期签约和转账指引

1、银期转账签约途径和签约时间

办理银期签约途径：银行柜台（机构客户）

办理时间：交易日8:30—16:00。

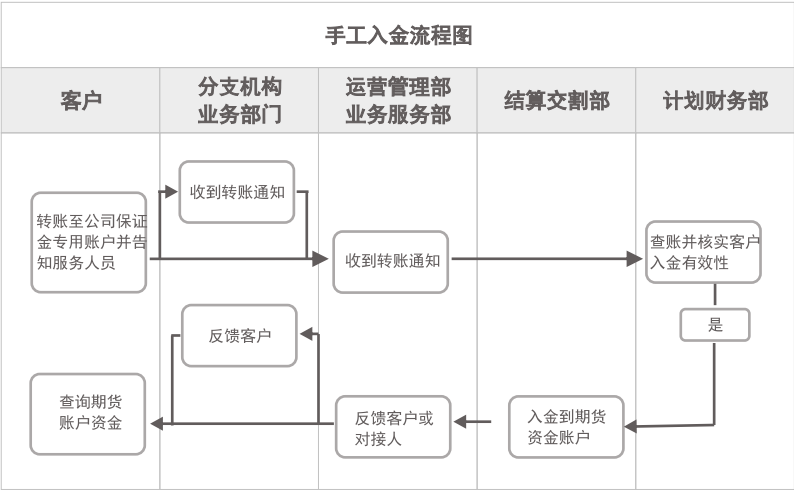
手工出入金操作指引

1、手工出入金办理时间

手工入金：交易日8:30--16:00
手工出金：交易日9:20--16:00

2、手工入金流程

手工入金是客户通过报备的期货结算账户电汇、银行转账等方式向公司保证金专用账户转入资金，公司相关部门根据客户资金到账手工在结算系统中添加客户资金的入金方式。

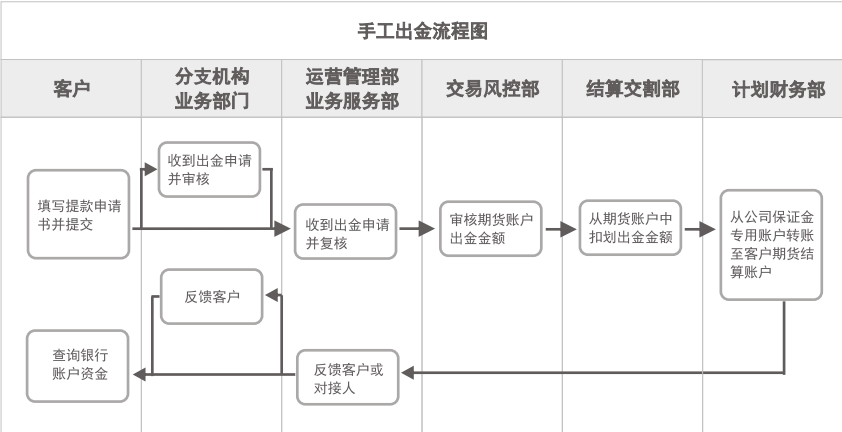


温馨提示：

- ①客户办理转账时，必须从客户报备的期货结算账户通过转账方式转入公司的保证金专用账户，而不能以现金汇入公司的保证金专用账户；
- ②客户资金必须以同行转账的方式转入公司的保证金专用账户，如工行转工行，建行转建行；
- ③客户须在银行转账备注栏中注明“资金账号”以及“期货保证金”字样，并将转账具体信息及时告知服务人员或致电公司客服热线，以便公司查询确认；
- ④公司保证金专用账户账号查询请登录公司官网-网上营业厅-客服中心-银期转账-保证金账号：<https://www.citicsf.com/e-futures/csc/000202>

3、手工出金流程

手工出金是客户通过书面方式提交出金指令，公司相关部门通过手工方式划拨客户指定资金到客户期货结算账户的出金方式。



温馨提示：

- ①办理手工出金时请填写《中信期货有限公司提款申请书》（以下简称提款申请书），通过邮件、传真或当面提交的方式，下达出金指令。
- ②“提款申请书”应为公司标准版本，须由您账户授权的资金调拨人签章并加盖公司资金调拨印鉴。
- ③“提款申请书”可通过公司官网-网上营业厅-客服中心-手工出入金介绍-常用表格下载获取：<https://www.citicsf.com/e-futures/csc/000201>

交易软件指引

1、交易软件下载和介绍

	软件名称	主要功能
电脑软件	 快期V2	独立的交易软件（无行情），支持期货、商品期权、股指期货、交易所套利组合单交易，支持条件单、止盈止损单（保存在电脑本地或公司服务器）。 【合约列表F6】可以查看所有品种的手续费标准
	 快期V3	行情和交易软件，支持期货、商品期权、股指期货、交易所套利组合单交易，支持条件单、止盈止损单、画线下单（保存在电脑本地或公司服务器）。
	 博易大师5	行情和交易软件，支持期货、商品期权、股指期货交易，支持条件单、止盈止损、画线下单（保存在电脑本地或公司服务器）。
	 文华财经Wh6	行情和交易软件，支持期货、商品期权、股指期货交易，支持止损止盈、条件单、画线下单（可保存在文华云服务器）。
	 极星9.5	行情和交易软件，支持期货、商品期权、股指期货、交易所套利组合单交易，支持条件单、止盈止损、画线下单（保存在电脑本地或公司服务器），支持多账户（免费）。功能与文华财经软件接近。
手机软件	 中信期货APP	 全功能版包含期货和基金的开户、交易以及资讯功能。行情和交易软件，支持期货、商品期权、股指期货和基金交易，支持条件单（保存在公司服务器）。交易登陆后右上方三横杆主菜单点击合约列表可查询手续费标准。
	 博易	 行情和交易软件，可查看资讯，支持期货、商品期权、股指期货、股票期权交易（条件单功能暂未开放使用，后期评估后再开放）。
	 中信期货博易APP	 行情和交易软件，专为期权交易设计的软件，支持商品期权和股指期货交易，提供不同的交易策略选择。

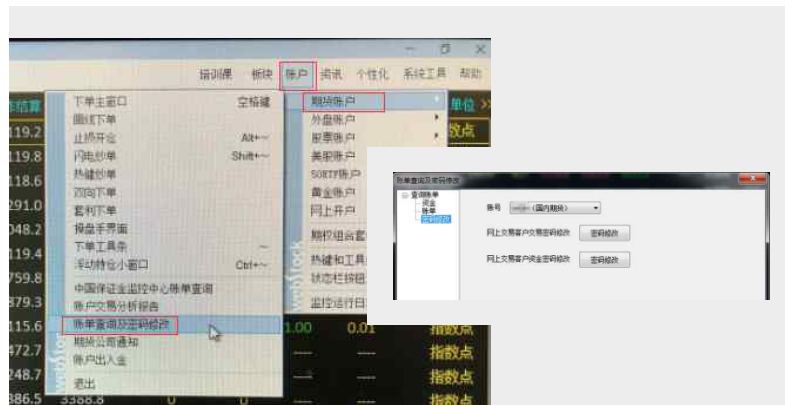
温馨提示：

- ①请在使用交易软件前查阅软件使用说明，熟悉软件功能避免误操作，软件使用说明详见软件下载栏目或各软件的“帮助”菜单；
- ②软件登录时提示“CTP不合法登录”一般是因为账号或者密码输入有误，请确认交易网关、交易账号和交易密码是否准确；
- ③博易大师行情登录界面用户名是zxqh，密码是zxqh，行情账号登录后再登录交易账号；
- ④快期登陆界面的“动态密码”不用输入。

2、如何使用交易软件修改密码

（1）文华财经WH6

点击菜单栏【账户】--【期货账户】--【账单查询及密码修改】--选择修改交易密码/资金密码--输入原密码和新密码



（2）博易大师

点击【修改密码】--选择修改交易密码/资金密码--输入原密码和新密码

您好! 可用资金

F1 交易
F2 当日委托
F3 当日成交
F4 持仓
F5 条件单
F6 查询
F7 行权
F8 参数设置
F9 帮助及说明
X 银期转账
C 交易统计
修改密码

密码类型: 交易密码
当前密码: 资金密码
新密码:
再次输入新密码:
修改

交易委托指引

1、交易时间

交易时段	交易所	品种	时间
日盘	上期所	所有上市品种	9:00--10:15
	郑商所		10:30--11:30
	大商所		13:30--15:00
	能源中心	国债期货	9:15--11:30, 13:00--15:15
	中金所		9:15--11:30 (最后交易日)
夜盘	中金所	股指期货、股指期权	9:30--11:30
			13:00--15:00
	上海证券 交易所	上证 50ETF 期权、沪深 300ETF 期权	9:30--11:30, 13:00--15:00
	深圳证券 交易所	沪深 300ETF 期权	14:57-15:00 (收盘集合竞价)
	能源中心	原油	21:00--23:00
夜盘	上期所	天然橡胶、沥青、螺纹钢、热轧卷板、纸浆、燃料油、天胶期权	21:00--23:00
		铜、铝、锌、铅、锡、镍、不锈钢、铜期权	21:00--1:00
		黄金、白银、黄金期权	21:00--2:30
	大商所	棕榈油、焦炭、焦煤、铁矿石、豆粕、豆油、豆一、豆二、聚乙烯、聚氯乙烯、聚丙烯、乙二醇、玉米、粳米、苯乙烯、玉米淀粉、液化石油气、豆粕期权、玉米期权、铁矿石期权、液化石油气期权	21:00--23:00
	郑商所	棉花、白糖、菜粕、甲醇、PTA、菜籽油、玻璃、精对苯二甲酸、动力煤、棉纱、纯碱、白糖期权、棉花期权、菜籽粕期权、PTA 期权、甲醇期权	21:00--23:00
夜盘	能源中心	20 号胶	21:00--23:00

提示:

- ①有夜盘交易的期货品种，集合竞价时间为：20:55--21:00；
- ②无夜盘交易的商品期货品种，集合竞价时间为：8:55--9:00
股指期货集合竞价时间为9:25--9:30，国债期货集合竞价时间为9:10--9:15；
- ③商品期货上午10:15--10:30休息，暂停交易；
- ④集合竞价前4分钟可以报单撤单，最后1分钟撮合成交时间不能报单和撤单。

(3) 快期V2

修改交易密码: 点击【系统】--【修改交易密码】--输入原密码和新密码

修改资金密码: 点击【银期转账】--【修改资金密码】--输入原密码和新密码

(4) 中信期货交易版APP

点击【右上方三横杆主菜单】--【修改密码】选择修改交易密码/资金密码--输入原密码和新密码

修改密码

交易密码 资金密码

旧密码 请输入旧密码

新密码 请输入新密码

确认密码 请再次输入旧密码

提交

2、交易品种

大连商品交易所					
品种	代码	合约乘数	最小变动价位	单笔最大下单(手)	最后交易日
大豆二	b	10	1	1000	合约月份第 10 个交易日
棕榈油	p	10	2	1000	
豆油	y	10	2	1000	
聚乙烯	l	5	5	1000	
聚氯乙烯	v	5	5	1000	
黄玉米	c	10	1	2000	
大豆一	a	10	1	1000	
玉米淀粉	cs	10	1	1000	
聚丙烯	pp	5	1	1000	
铁矿石	i	100	0.5	1000	
豆粕	m	10	1	1000	
焦炭	j	100	0.5	500	
焦煤	jm	60	0.5	1000	
纤维板	fb	10	0.5	1000	
胶合板	bb	500	0.05	1000	
粳米	rr	10	1	1000	
苯乙烯	EB	5	1	1000	合约月份倒数第 4 个交易日
鸡蛋	jd	10	1	300	
乙二醇	EG	10	1	1000	
液化石油气	PG	20	1	1000	标的期货合约交割月前一个月第 5 个交易日
豆粕期权	M-合约月份-C-行权价格 M-合约月份-P-行权价格	10	0.5	限价：100	
玉米期权	C-合约月份-C-行权价格 C-合约月份-P-行权价格	10	0.5	限价 100	
铁矿石期权	I-合约月份-C-行权价格 I-合约月份-P-行权价格	100	0.1	限价 1000	
液化石油气期权 ^{①②}	PG-合约月份-C-行权价格 ^{①②} PG-合约月份-P-行权价格 ^{①②}	20 ^{①②}	0.2 ^{①②}	限价 1000 ^{①②}	

上海国际能源交易中心					
品种	代码	合约乘数	最小变动价位	单笔最大下单(手)	最后交易日
原油	sc	1000	0.1	500	前月最后一个交易日
20 号胶	nr	10	5	500	合约月份的 15 日

郑州商品交易所					
品种	代码	合约乘数	最小变动价位	单笔最大下单(手)	最后交易日
早籼稻/晚籼稻	RI /LR	20	1	合约交割月第 10 个交易日	
棉纱	CY	5	5		
苹果	AP	10	1		
强麦	WH	20	1		
普麦	PM	50	1		
菜籽油	OI	10	2		
菜籽	RS	10	1		
粳稻	JR	20	1		
白糖	SR	10	1		
玻璃	FG	20	1		

郑州商品交易所					
玻璃	FG	20	1	限价 1000 ^元 市价 200 ^元	合约交割月份的 第 5 个交易日
硅铁	SF	5	2		
精对苯二甲酸	TA	5	2		
菜粕	RM	10	1		
棉花	CF	5	5		
甲醇	MA	10	1		
锰硅	SM	5	2		
动力煤	ZC	100	0.2		
红枣	CJ	5	5	市价：2 限价：100	合约交割月第 10 个交易日
尿素	UR	20	1		
纯碱	SA	20	1		
白糖期权	SRC/SRP	10	0.5		
棉花期权	CFC/CFP	5	1	市价：2 限价：100	标的期货合约交 割月份前一个月 的第 3 个交易日， 以及交易所规定 的其他日期
甲醇期权	MAC/MAP	10	0.5		
菜籽粕期权	RMC/RMP	10	0.5		
PTA 期权	TAC/TAP	5	0.5		

上海期货交易所					
品种	代码	合约乘数	最小变动价位	单笔最大下单(手)	最后交易日
铝	al	5	5	500	合约月份的 15 日 (遇国家法定节假日 顺延，春节月份 等最后交易日交 易所可另行调整 并通知)
铅	pb	5	5	500	
锡	sn	1	10	500	
锌	zn	5	5	500	
黄金	au	1000	0.02	500	
螺纹钢	rb	10	1	500	
白银	ag	15	1	500	
铜	cu	5	10	500	
热轧卷板	hc	10	1	500	
镍	ni	1	10	500	
沥青	bu	10	2	500	
天然橡胶	ru	10	5	500	
线材	wr	10	1	500	
纸浆	sp	10	2	500	
不锈钢	ss	5	5	500	
燃料油	fu	10	1	500	前月最后一个交 易日
铜期权	CU-合约月份-C- 行权价格 CU-合约月份-P-	5	1	100	标的期货合约交 割月份前一个月 的倒数第 5 个交

上海期货交易所					
品种	代码	合约乘数	最小变动价位	单笔最大下单(手)	最后交易日
铜期权	CU-合约月份-C- 行权价格	5	1	100	标的期货合约交割月份前一个月的倒数第5个交易 日,以及交易所规定的其他日期
	CU-合约月份-P- 行权价格				
天然橡胶期权	RU-合约月份-C- 行权价格	10	1	100	
	RU-合约月份-P- 行权价格				
黄金期权	AU-合约月份-C- 行权价格	1000	0.02	100	
	AU-合约月份-P- 行权价格				

 **提示：**上期所部分品种持仓进入交割月需满足持仓倍数要求：铝、铜、锌、铅调整为5手的整数倍，白银、锡、纸浆调整为2手的整数倍，黄金调整为3手的整数倍，螺纹钢、线材、热轧卷板调整为30手的整数倍，镍调整为6手的整数倍，不锈钢调整为12手的整数倍。

中国金融期货交易所					
品种	代码				
2 年期国债	TS	20000	0.005	限价 50 市价 30	合约到期月份的第 2 个周五
5 年期国债	TF	10000	0.005		
10 年期国债	T	10000	0.005		
沪深 300	IF	300	0.2	限价 20 市价 10	合约到期月份的第 3 个周五
上证 50	IH	300	0.2		
中证 500	IC	200	0.2		
沪深 300 指数期 权	IO 合约月 份-C-行 权价格	100	0.2	限价 20	
	/IO 合约 月份-P- 行权价格				

声明：以上内容与交易所不一致的，以交易所公告为准。

 **温馨提示：**如在交易中遇到无法委托的情况，可以先进行以下排查：

- ① 期货账户是否具有交易的品种所属交易所的交易编码或交易权限（当日开户申请的交易编码下一交易日才能使用）；
 - ② 账户可用资金是否能足额抵扣保证金和手续费（交易所、公司会根据市场情况调整保证金收取标准，买单市价委托软件端会以涨停板价格冻结保证金）；
 - ③ 委托时间是否在交易时间内（集合竞价撮合成交时间和非交易时间不能委托）；
 - ④ 委托指令内容（交易合约、手数、价格、买卖方向）是否符合交易规则要求。
- 如您排查后仍无法解决可拨打4009908826或联系相应服务人员解答。

3、保证金和手续费计算

冻结保证金=委托价格×合约乘数×保证金收取标准×手数

手续费（按固定金额标准）=手续费标准×手数

手续费（按成交金额标准）=委托价格×合约乘数×手续费标准×手数

 **温馨提示：**

- ① 手续费标准可在快期V2软件或手机中信期货APP的合约列表菜单查询，针对部分品种日内交易，交易所提高了日内交易手续费标准，请您留意。
- ② 保证金收取标准可在快期V2软件或公司官网【交易提示】栏目查看，交易所、公司将根据市场情况调整保证金收取标准，请及时关注最新保证金标准。

4、风险度计算

公司风险度=按公司规定的保证金收取标准计算的持仓保证金公/客户权益×100%

 **温馨提示：**当公司风险度>100%时，您需要及时补足资金或自行减仓以维持账户“

公司风险度 100%水平，否则我司有权根据合同约定对您的账户持仓进行强行平仓，请您及时关注账户风险并及时跟进账户风险处理，理性投资。

5、资金风险通知

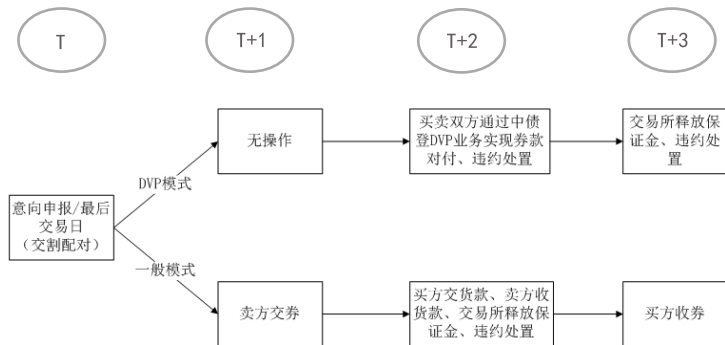
若您T日结算后账户出现资金风险的（即风险度>100%），我司通过中国期货市场监控中心、手机短信进行通知；若您T日结算后账户无资金风险（即账户风险度≤100%），T+1日盘中出现资金风险（即风险度>100%）的，我司通过系统通知、手机短信或录音电话等方式进行通知。

交割及套保套利业务指引

1、参与国债交割的准备和条件

- (1) 已报备有效国债托管账户（中金所）
- (2) 确定交割仓位；
- (3) 买方准备足额货款；
- (4) 卖方备足有效无权利瑕疵的可交割国债

2、国债交割业务申请流程



温馨提示：目前中金所国债期货各品种实行滚动交割，无意交割的买方客户，建议不要持仓进入交割月，以免被动配对进入交割造成额外的损失。

3、套期保值与套利额度申请资质

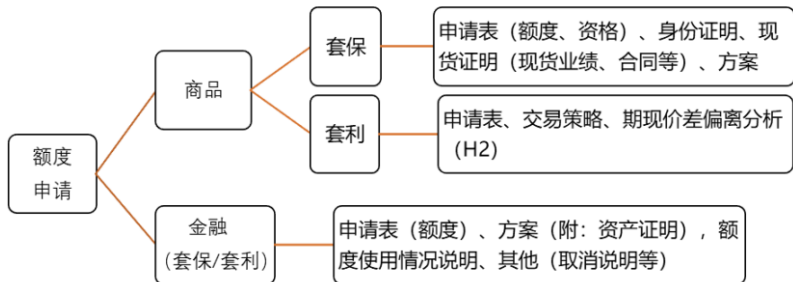
(1) 商品期货申请套保资质：客户具备相关品种生成经营资格；

商品期货申请套利资质：大商所要求客户不能有套保资格，郑商所目前不提供套利额度申请，上期所与能源中心暂不做特殊要求。

(2) 金融期货申请套保资质：已获批套保交易编码；

金融期货申请套利资质：已获批套利交易编码。股指只接受集合信托客户需求申请，国债不限。

4、套期保值与套利额度申请材料



5、套期保值与套利额度申请流程

- (1) 客户准备申请额度所需材料、提供相关证明材料，并确保材料真实有效；
- (2) 期货公司审核客户的申请材料，并对审核通过的材料用印递交交易所；
- (3) 交易所审核客户提供的申请材料，对审核通过的材料5个交易日内予以答复，额度于获批的下一个交易日生效。

查询交易账单指引

1、账单查询的方式

- (1) 登陆交易软件查询结算单
- (2) 登录中国期货市场监控中心（www.cfmmc.com）查询或直接登录如下网址：<https://investorservice.cfmmc.com/>（中国期货市场监控中心投资者查询服务系统）。

2、账单内容解析

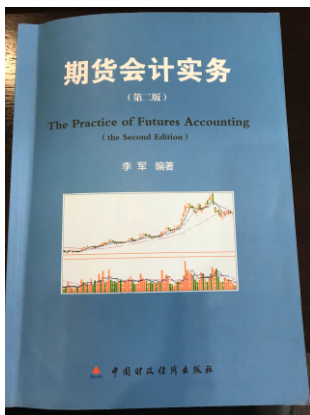
每日交易前需登录交易软件确认前一日的结算单才能委托，请您及时确认账单，如前一日未进行资金划转或交易委托则无账单。

目前交易所和我司均采用逐日盯市的结算方式，结算单中各项数据计算公式如下：

- (1) 平仓盈亏=当日平仓盈亏+历史平仓盈亏
 - ① 平当日仓盈亏=当日开仓价与平仓价之差×手数×交易单位
 - ② 平历史仓盈亏=平仓价与昨日结算价之差×手数×交易单位
- (2) 持仓盯市盈亏=持当日仓盈亏+持历史仓盈亏
 - ① 持当日仓盈亏=当日结算价与当日开仓价之差×手数×交易单位
 - ② 持历史仓盈亏=当日结算价与昨日结算价之差×手数×交易单位
- (3) 当日盈亏=平仓盈亏（逐日盯市）+持仓盈亏（逐日盯市）
- (4) 当日结存=上日结存±当日出入金±当日盈亏-当日手续费
- (5) 客户权益=当日结存
- (6) 保证金占用=当日结算价×合约单位×持仓手数×保证金收取标准
- (7) 可用资金=客户权益-保证金占用
- (8) 风险度=按公司规定的保证金收取标准计算的持仓保证金/客户权益×100%
- (9) 追加保证金=保证金不足时须追加的金额（需追加至可用资金≥0）
- (10) 质押金=客户以标准仓单或国债等作抵押折算成交易保证金时的金额

期货投资业务会计处理

参考资料：一般法人客户如需对期货投资业务进行相应的会计处理，可参阅《期货会计实务》（中国财政经济出版社，李军编著）第五、六章内容。



异常交易及报备业务指引

1、实际控制关系账户

各交易所实际控制关系认定标准

根据实质重于形式的原则，具有下列情形之一的，应当认定为行为人对他人期货账户的交易具有实际控制关系：

（一）行为人作为他人的控股股东，即行为人的出资额占他人资本总额50%以上或者其持有的股份占他人股本总额50%以上的股东，出资额或者持有股份的比例虽然不足50%，但依其出资额或者持有的股份所享有的表决权已足以对股东会、股东大会的决议产生重大影响的股东；

（二）行为人作为他人的开户授权人、指定下单人、资金调拨人、结算单确认人或者其他形式的委托代理人；

（三）行为人作为他人的法定代表人、主要合伙人、董事、监事、高级管理人员等，或者行为人与他人的法定代表人、主要合伙人、董事、监事、高级管理人员等一致的；

（四）行为人与他人之间存在配偶关系；

（五）行为人与他人之间存在父母、子女、兄弟姐妹等关系，且对他人期货账户的日常交易决策具有决定权或者重大影响；

（六）行为人通过投资关系、协议、融资安排或者其他安排，能够对他人期货账户的日常交易决策具有决定权或者重大影响；

（七）行为人与他人交易行为具有一致性且存在一方向另一方提供期货交易资金的，或者行为人与他人交易行为具有一致性且双方交易终端信息一致的；

（八）行为人对两个或者多个他人期货账户的日常交易决策具有决定权或者重大影响；

（九）中国证监会规定或者交易所认定的其他情形。

温馨提示：根据实质重于形式的原则，若您符合上述认定标准或者各交易所及监控中心关于实际控制关系账户的相关规定，请您主动履行实际控制关系账户的报备及变更程序。同时，请您遵守各交易所及监控中心关于实际控制关系账户的相关规定，接受交易所及我司对您实际控制关系账户的管理。若您存在不报、漏报、未及时报备实际控制关系账户的情况，将可能被监管部门采取谈话提醒、书面警示、限制期货业务等措施，由此带来的损失将由您自行承担。

2、程序化交易

根据各交易所关于程序化交易报备业务的通知及指引，程序化交易是指由计算机按照事先设定的具有行情分析、风险管理等功能的交易模型，自动下达交易信号或报单指令的交易方式。

温馨提示：各交易所对程序化交易客户实行报备制度，若您涉及程序化交易，请您按照各交易所要求事先主动向我司提供程序化交易软件及软件功能等方面的信息进行程序化交易申报。同时，请您遵守各交易所关于程序化交易的相关规定，接受交易所及我司对您程序化交易的管理。若您存在不报、漏报、未及时报备程序化交易的情况，将可能被监管部门采取谈话提醒、书面警示、限制期货业务等措施，由此带来的损失将由您自行承担。

3、大户报告

各交易所实行大户报告制度。当您持有的合约达到交易所规定的持仓报告标准或交易所要求进行大户报告时，您应在各交易所规定的时限内主动通过我司向各交易所报告您的资金情况、头寸情况。您应当保证所提供的大户持仓报告和其他材料的真实性、准确性和完整性。

💡 温馨提示：若您存在不报、漏报、未在规定时限内完成大户报告等情形的，将可能被监管部门采取约谈警告、通报批评、公开谴责、暂停部分期货业务、暂停开仓交易，罚款等措施，由此带来的损失将由您自行承担。

4、异常交易

请您参与期货交易时，应当遵守法律、法规和各交易所业务规则的规定，接受各交易所监管及我司的合法合规管理，自觉规范交易行为。避免出现各交易所认定的异常交易行为，包括但不限于自成交行为，频繁报撤单行为，大额报撤单行为，实控组合并持仓超限行为，通过计算机程序自动批量下单、快速下单影响交易所系统安全或者正常交易秩序行为、过度交易行为及更交易所认定的其他情形（具体认定标准可咨询我司客服热线或所在分支机构）。

💡 温馨提示：请您避免在日常期货交易过程中出现上述的异常交易行为，否则将可能被监管部门采取要求报告、列入交易所重点关注名单、向全市场会员通报、约见谈话、限期平仓、限制开仓、强行平仓等措施。若您被采取限制开仓自律管理措施的，监管机构将向市场公告。涉嫌违反法律法规的，监管机构将提请中国证监会进行立案调查，由此带来的损失将由您自行承担。

⚠️ 郑重提示：以上相关业务，若您违反各交易所等监管机构及我司的相关规定，我司有权对您的账户采取冻结可用资金、限制出金、限制开新仓、提高保证金收取标准、限期平仓、强行平仓或者终止经纪关系等措施，由此造成的一切损失，均由您承担。



免责声明：

此手册所载内容仅作参考使用，如以上内容与交易所不同，请以交易所公布为准。