



**心中有信
未来可期**

**一般法人投资者
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。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。

《一般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。

开户指引

1、开户要求

- （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）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）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。

2、开户方式

线下办理（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

客户类型	开户所需提供的基本资料
境内一般法人客户	《企业法人营业执照》
	开户代理人头部正面照
	开户代理人身份证
	法定代表人及被授权人身份证明文件
	代理人授权委托书
	银行开户许可证
	公司章程(合伙协议)
	开户所需提供的其他相关材料

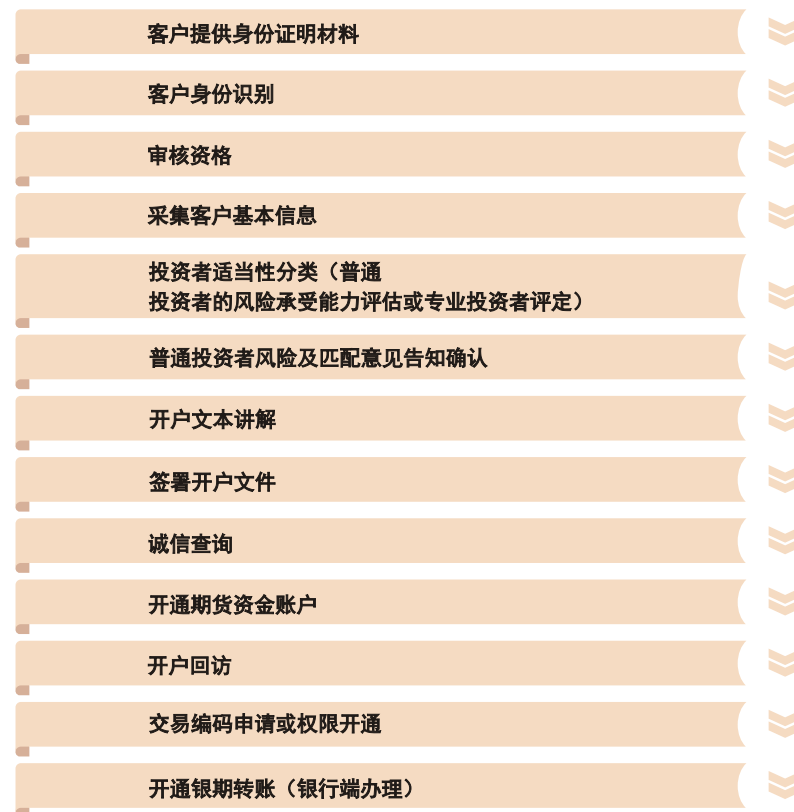
客户类型	开户所需提供的基本资料
境外及港澳台单位客户	商业登记证
	纳税证件
	单位授权委托书
	开户代理人头部正面照
	开户代理人身份证明文件
	常务董事或者法定代表人头部正面照
	常务董事或者法定代表人有效身份证明文件（见说明）
	常务董事或者法定代表人参考身份证明文件（见说明）
	相关被授权人身份证明文件
	开户所需提供的其他相关材料

说明：①境外客户对有效和参考身份证明文件罗列

交易者类型	有效身份证明文件	参考身份证明文件
境外及港、澳、台地区的单位交易者	注册国（或者地区）的商业登记证	注册国（或者地区）的纳税证件
※境外及港、澳、台地区单位交易者的常务董事、法定代表人	包括护照、外国人永久居留证、港澳永久性居民身份证和台湾居民来往大陆通行证	护照（仅限常务董事或者法定代表人在中国永久居留的使用）、驾照、当地社保证件、当地纳税证件、当地身份证正反面、港澳居民来往内地通行证和其他参考证件

②境外及港澳台单位客户目前仅能参与特定品种期货交易，品种包括铁矿石、PTA、20号胶和原油。

4、线下开户流程



5、境内一般法人客户首次开通金融期货、商品期权和特定品种交易权限的适当性要求

	具体要求
可用资金	参与商品期权和特定品种期货交易的，申请前连续5个交易日均≥10万元或等值外币（参与原油期货交易的，一般法人≥100万元或等值外币）； 参与金融期货或股指期货交易的，申请开立交易编码前连续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。
知识测试	机构客户指定下单人通过协会考试平台考试且成绩≥80分
交易经历	真实或仿真二选一： 真实：近三年境内外期货、期权或集中清算的其他衍生品真实交易记录≥10笔（境外交易经历仅申请特定品种期货和商品期权适用） 仿真：境内期货或期权仿真交易记录累计≥10个交易日、20笔及以上
内部制度	机构客户需具有健全的内部控制、风险管理等期货交易管理相关制度。
其他要求	不存在严重不良诚信记录或者被有权监管机构宣布为期货市场禁止进入者的情形； 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交易的情形。

6、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。

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。

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、广发银行（只支持郑州和大连）、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）。

说明：目前我司能为境外机构提供美元银期转账方式的银行为交通银行、工商银行、中国银行、中信银行、招商银行和星展银行。

3、银期签约所需资料

手工出入金操作指引

境内一般法人：

- (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

境外及港澳台单位：

- (1) 有效的企业注册登记证
- (2) 有效的商业登记证（满1年需提供周年申报表）
- (3) 法团成立表格或者周年申报表（注册未滿1年的提供，注册滿1年的提供周年申报表）
- (4) 董事身份证或者护照（打印联网核查、经办盖章）
- (5) 董事会决议
- (6) 经办人身份证
- (7) 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联系您的客户经理或公司服务热线4009908826咨询。

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。

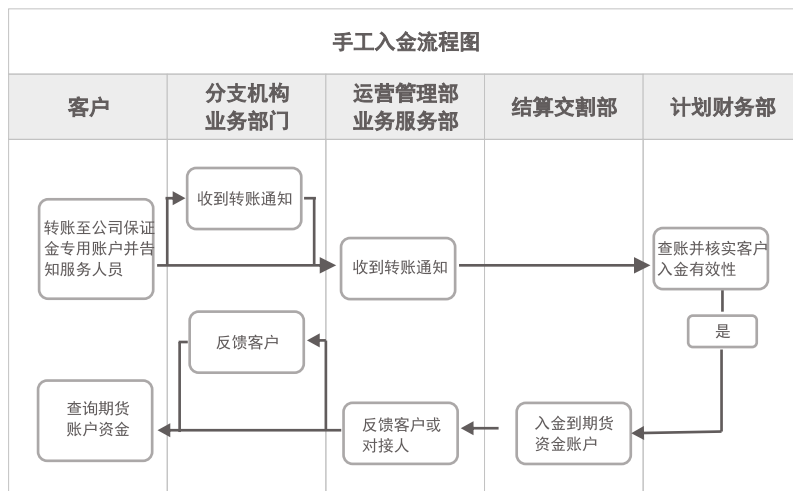
1、手工出入金办理时间

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。

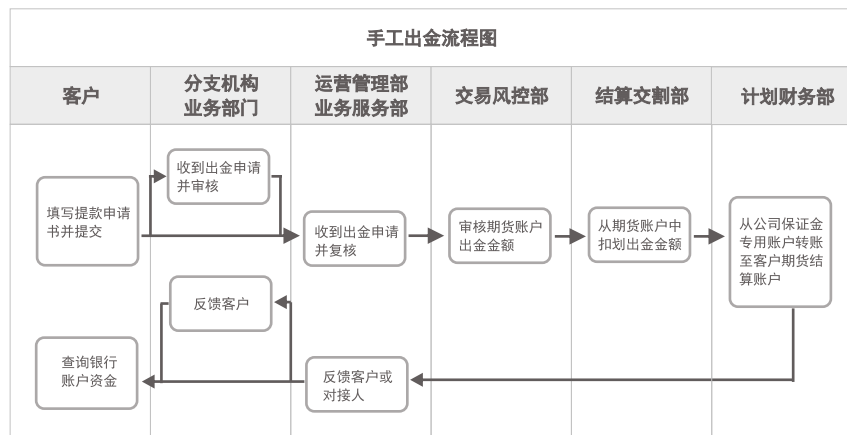


☀️ 温馨提示：

- 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出出金指令，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

交易软件可登录公司官网<https://www.citicsf.com/e-futures/> 【软件下载】菜单下载，主要交易软件功能如下，更多交易软件请登录公司官网下载：

	软件名称	主要功能
电脑软件 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 中信期货博易APP	 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）。
手机软件	 中信咏春GO (期权专属软件)	 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。

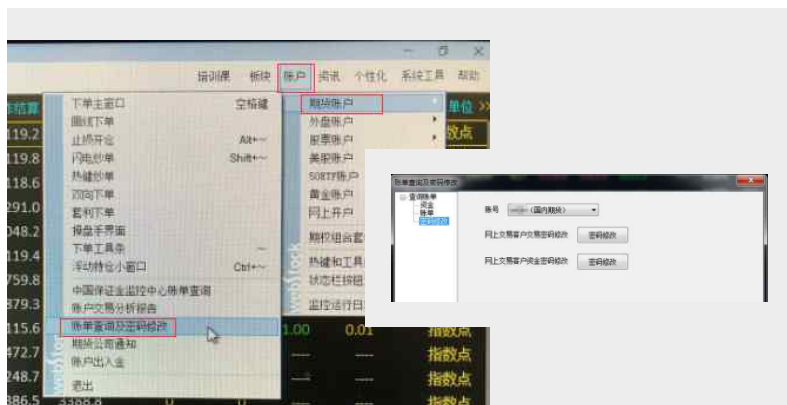
温馨提示:

- 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

(3) 快期V2



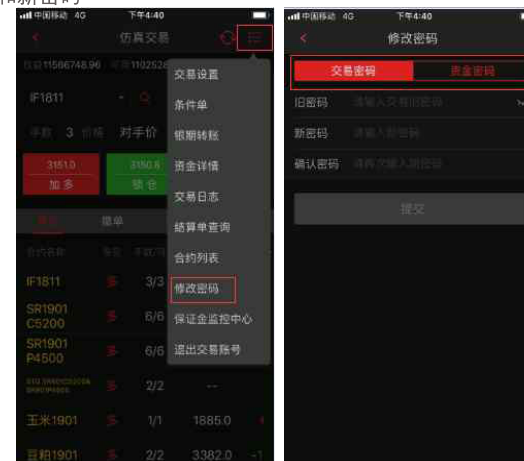
修改交易密码:点击【系统】--【修改交易密码】--输入原密码和新密码



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



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 郑商所 大商所 能源中心	所有上市品种	9:00—10:15 10:30—11:30 13:30—15:00
	中金所	国债期货	9:15—11:30, 13:00—15:15 9:15—11:30 (最后交易日)
		股指期货、股指期权	9:30—11:30 13:00—15:00 14:57—15:00 (股指期权收盘集合竞价)
	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)
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
	能源中心	原油	21:00— 2:30
		20 号胶	21:00—23:00

☀ 温馨提示:

- 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。

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	合约月份倒数第 4 个交易日
苯乙烯	EB	5	1	1000	
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	100	0.1	限价 1000	

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	限价1000 市价200	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 市价200	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		
尿素	UR	20	1		
纯碱	SA	20	1	市价: 2 限价: 100	合约交割月第 10 个交易日
白糖期权	SRC/SRP	10	0.5		
棉花期权	CFC/CFP	5	1		
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场所可另行调整并通知) 前月最后一个交易日
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	

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 CU-合约月份-P-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
天然橡胶期权	RU-合约月份-C-行权价格 RU-合约月份-P-行权价格	10	1	100	
黄金期权	AU-合约月份-C-行权价格 AU-合约月份-P-行权价格	1000	0.02	100	

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	合约乘数	最小变动价位	单笔最大下单(手)	最后交易日
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 /IO 合约月份-P-行权价格	100	0.2	限价 20	

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/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

☀ 温馨提示：

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、参与实物交割（商品、国债）的准备和条件

（1）能够开具/接收相应品种增值税专用发票（普通）发票。境内机构在首次申报原油、20号胶、铁矿石与PTA期货保税交割业务免税时，请提前向主管税务机关办理免税备案；

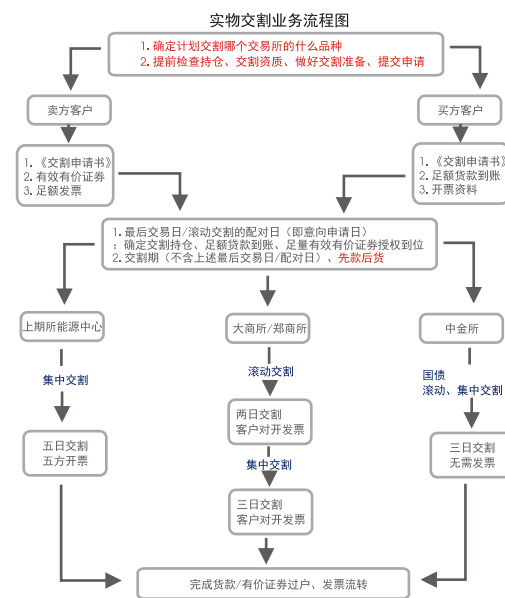
（2）仓单系统已开通并可正常登陆（上期所、能源中心），已报备危化证（甲醇、苯乙烯、液化石油气），已报备有效国债托管账户（中金所）；

（3）确定交割单位，持仓及时取整，郑商所申请非对冲交割的最晚于最后交易日上午前提出；

（4）买方准备足额货款、开票资料与发票邮寄信息；

（5）卖方备足无权利瑕疵可交割债券/有效仓单（质检与仓单有效期、仓单流通、仓储费缴足）与发票额度。其中，能源中心品种客户须确保最后交易日前三个交易日内闭市前已持有足量仓单，否则平仓。郑商所注册时间限制：仓库仓单需最后交易日（WH、SR、OI 为第5个交易日）15:00前，质量免检品种为最后交易日前一日；厂库仓单—最后交易日前三个交易日15:00前。

2、交割业务申请流程



☀ 温馨提示：

1、铁矿石与PTA保税交割不适用于图中“客户对开发票”，而是采用五方开票。

2、目前大商所a、b、c、cs、m、y、jd、eb、eg、rr、pg与郑商所AP、CJ以及中金所国债期货等品种的买方持仓存在被配对进入交割的风险。对于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

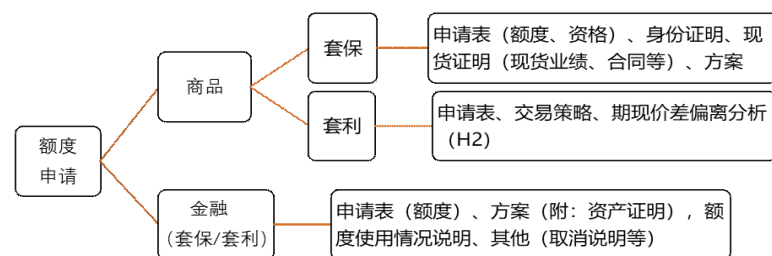
(1) 商品期货申请套保资质：客户具备相关品种生成经营资格；

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续期申请，国债不限。

4、套期保值与套利业务申请材料



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个工作日内予以答复，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

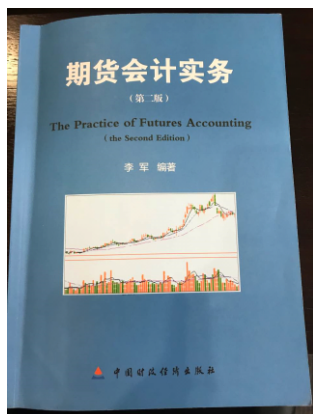
每日交易前需登录交易软件确认前一日的结算单才能委托，请您及时确认账单，如前一日未进行资金划转或交易委托则无账单。

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×保证金比例
- (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比例计算的交易保证金/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。



（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为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。

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；

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。