

# 交易者适当性品种交易特别风险揭示书

尊敬的客户：

本揭示书只扼要陈述交易者适当性品种交易的风险，并未完全披露与交易者适当性品种交易有关的所有风险和其他重要事项。您应当充分理解交易者适当性品种合约交易的全部交易规则、交割与执行期权（行权）规则以及相关风险，并遵循“买卖自负”的金融市场原则，充分认识交易者适当性品种交易风险，自行承担交易结果。

您在考虑是否进行交易者适当性品种交易时，应当明确以下几点：

一、您应通过相应的适当性评估或者提供符合适当性评估豁免条件证明文件后，方能申请开通或关闭交易者适当性品种交易权限或交易编码。

二、您应当了解交易者适当性品种合约的基础知识、相关法律法规、期货交易所的业务规则及期货公司的有关规定，充分了解交易者适当性品种合约交易风险、期权合约行权及履约风险。

三、您应当充分了解期权交易与期货交易的区别，了解期权合约交易风险的特点。

（一）期权合约交易采取权利金和保证金的交易方式，如您购买期权可能没有任何收益甚至损失全部投资，如您购买深度虚值期权，您应当知道该类型期权盈利的可能性通常微乎其微；如您卖出期权可能发生巨额损失，这一损失可能远大于该期权权利金并可能超过您存放在期货公司的全部初始保证金以及追加保证金并无限大。

（二）您应当充分了解到，期权合约交易可能面临平仓、行权或期权到期放弃等几种后果，您应当熟知交易所期权平仓、行权的规则和程序，特别是有关实值期权到期自动行权，虚值期权到期自动放弃的交易规则，妥善处理期权持仓。如您买入期权，行权应该在交易所规定的时间内进行；如您卖出期权，则需要按照交易所规则承担履约责任。行权或履约后，您将获得标的期货合约，同时应当承担标的期货合约的保证金责任。

（三）您应当充分了解到，在因市场行情波动剧烈出现单边涨跌停价格、投资者缺乏投资兴趣、流动性的变化或其他因素给某些合约市场的流动性、有效性、持续性等带来不利影响时，您可能会难以或无法将持有的未平仓期货合约或期权合约平仓。如出现这类情况，您的所有保证金有可能无法弥补全部损失，您必须承担由此导致的全部损失。

（四）交易所可能会对期货合约或期权合约的交易和行权（履约）进行一些限制。交易所所有权根据市场需要暂停期货合约或期权合约交易，如果标的期货合约暂停交易，对应期权合约交易也将暂停交易，由此产生的一切后果由您自行承担。

（五）若您作为期权买方申请行权的，应提前准备行权所需的资金（买方行权需准备行权手续费和相应期货合约持仓的交易保证金），并通过期货公司向交易所提出行权申请，期货公司审核您资金是否充足，在交易所规定的时间内，决定是否向交易所申报您的行权申请。在期权到期日，资金不足的实值期权（对应标的期货结算价）买方，期货公司将代客户提交批量放弃，避免交易所自动行权造成客户期货交易保证金的不足。您需要承担因资金不足等原因造成行权失败的后果。

（六）若您作为期权卖方，依照规定履行行权义务后，若出现保证金不足、持仓超限等情况的，应承担由此可能被强行平仓的后果。

四、您应当了解我国场内期权品种交易属于新的市场交易品种，期权市场发育不成熟，不确定性因素多，市场波动较为频繁。期权合约以对应期货合约为基础，期权合约价格的波动往往大于期货合约价格的波动。因此，您的投资可能会面临巨大的风险。

五、开通或开立交易者适当性品种交易权限、交易编码，实行投资者适当性制度，您应当满足中国证监会、交易所及期货公司关于投资者适当性标准的规定。投资者适当性制度对您的各项要求以及依据制度对您进行的评价，不构成对您的投资建议，不构成对您的获利保证。

您必须充分理解交易者适当性品种交易投资者所应当具备的经济能力、专业知识、相关交易经历要求，评估自身的经济承受能力、风险控制能力、身体及心理承受能力，审慎决定自己是否参与交易者适当性品种交易。

六、您应当充分理解并遵循“买卖自负”的市场原则，充分认识交易者适当性品种交易的风险，根据相关市场信息理性判断、自主决策，并自行承担交易后果，不得以不符合适当性标准为由拒绝承担交易履约责任。

七、您应当充分理解并遵守下列事项：

（一）知晓并遵守期货交易所持仓限额、交易限额规定

您应当知晓并遵守期货交易所对期货合约与期权合约的持仓限额、交易限额的有关规定。

您如果违反上述规定，可能被采取限制开仓、强行平仓等措施，由此造成的一切损失，均由您承担。

（二）知晓并遵守期货交易所有关异常交易、程序化交易、实际控制关系账户的有关规定

您应当知晓并遵守期货交易所对自买自卖、频繁报撤单及其他异常交易行为和实际控

制关系账户的有关规定。

您应当知晓交易所关于程序化交易行为的定义，遵守程序化交易的相关规定，如存在符合交易所定义的程序化交易行为，应及时告知我公司，由我公司向交易所报备。

您应当知晓并遵守交易所有关实际控制关系账户认定及报备的相关规定。

如您违反上述规定，经我公司提醒、劝阻、制止无效时，我公司有权采取提高交易保证金、限制开仓、强行平仓、限制出金、拒绝客户委托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。

### （三）知晓并遵守法律法规、交易所交易规则及相关业务规定

客户应当严格遵守国家法律法规、交易所交易规则及相关业务规定、产品特征，主动学习和研究相关内容，及时关注内容变化。您可以通过以下交易所官网进行查阅：

大连商品交易所：<http://www.dce.com.cn>； 郑州商品交易所：<http://www.czce.com.cn>；

上海期货交易所：<http://www.shfe.com.cn>； 广州期货交易所：<http://www.gfex.com.cn>；

上海国际能源交易中心：<http://www.ine.cn>； 中国金融期货交易所：<http://www.cffex.com.cn>

### （四）知晓并遵守反洗钱、反恐怖融资、反逃税法律法规的有关规定

您应当知晓不得利用期货账户从事洗钱或恐怖融资活动、不得有逃税行为，知晓期货公司作为金融机构承担反洗钱、反恐融资、反逃税义务，您应积极配合期货公司开展反洗钱、反恐融资、反逃税工作，包括但不限于客户身份识别、可疑交易报告、风险等级划分、账户实际控制关系申报等。

如果您存在洗钱、恐怖融资或逃税行为，需要承担法律责任，构成犯罪的，将被追究刑事责任。

### （五）知晓不得参与期货市场非法配资活动

您应当知晓非法配资活动违反了期货市场有关开户管理、账户实名制、期货经纪业务等方面的法律法规。

如果您参与非法配资活动，期货公司有权采取拒绝客户委托或者终止经纪关系等措施，并向中国证监会及其派出机构报告，由此造成的一切损失，均由您承担。

八、您应当充分了解到，从事期货交易您应当承担的所有手续费和相关税费的明确解释。

本《交易者适当性品种交易特别风险揭示书》是对从事交易者适当性品种交易投资者的特别提示，为全面了解期货交易、期权交易的风险，您在入市交易前，必须同时阅读并

签署《期货交易风险说明书》、《客户须知》。

以上《交易者适当性品种交易特别风险揭示书》的各项内容，本人/单位已阅读并完全理解。

(请抄写以上划线部分)

---

---

自然人客户本人/单位客户授权人签字：

单位客户加盖公章：

签署日期：        年        月        日