

《中国金融期货交易所套期保值管理办法》 PDF转换可能丢失图片或格式，建议阅读原文

https://www.100test.com/kao_ti2020/326/2021_2022__E3_80_8A_E4_B8_AD_E5_9B_BD_E9_c36_326578.htm 第一章 总则第一条 为发挥期货市场的套期保值功能，促进期货市场的规范发展，根据《中国金融期货交易所交易规则》，制定本办法。第二条 会员、客户在中国金融期货交易所（以下简称交易所）从事套期保值业务应当遵守本办法。第二章 套期保值额度的申请与审批第三条 交易所实行套期保值额度审批制度。客户申请套期保值额度的，应当向其开户的会员申报，会员对申报材料进行审核后向交易所办理申报手续。会员申请套期保值额度的，直接向交易所办理申报手续。第四条 申请套期保值额度的会员或者客户，应当填写《中国金融期货交易所套期保值额度申请（审批）表》，并向交易所提交下列申请材料：（一）自然人客户应当提交本人身份证复印件，会员或者法人客户应当提交营业执照副本复印件、组织机构代码证复印件以及近2年经审计的资产负债表、损益表、现金流量表；（二）近6个月的现货交易情况；（三）申请人的套期保值交易方案；（四）申请人历史套期保值交易情况说明；（五）会员对申请人材料真实性的核实声明；（六）交易所规定的其他材料。第五条 申请人可以一次申请多个月份合约的套期保值额度。合约最后交易日前10个交易日(含)内，交易所不受理该合约的套期保值额度申请。第六条 套期保值额度由交易所根据套期保值申请人的现货市场交易情况、资信状况和市场情况审批。批准的套期保值额度不超过其所提供的套期保值证明材料中所申请的数量。第七条 交易所在收到套

期保值额度申请后5个交易日内完成审核，并按照下列情形分别处理：（一）符合套期保值条件的，通知其准予办理；（二）不符合套期保值条件的，通知其不予办理；（三）相关申请材料不足的，告知申请人补充申请材料。交易所应当将套期保值的审核结果报告中国证监会。

第八条 套期保值额度分合约进行审批，在合约最后交易日前（含）有效，有效期内可以重复使用。

第九条 交易所所有权根据市场情况对套期保值额度进行调整。

第十条 申请人需要调整套期保值额度时，应当及时向交易所书面提出变更申请。

第三章 套期保值监督管理

第十一条 交易所对申请人提供的有关经营状况、资信情况及期货、现货市场交易行为进行监督和调查，会员及相关客户应当予以协助和配合。交易所所有权要求获批套期保值额度的申请人，报告现货、期货交易情况。

第十二条 交易所对会员或者客户获批套期保值额度的使用情况进行监督管理。会员或者客户套期保值期货持仓超过其相应的现货资产配比要求的，交易所所有权要求其限期调整；逾期未进行调整或者调整后仍不符合要求的，交易所所有权对其套期保值额度进行调整或者取消其套期保值额度，必要时可以采取限制开仓、限期平仓、强行平仓等处置措施。

第十三条 获批套期保值交易的会员或者客户在套期保值额度内频繁进行开平仓交易的，交易所所有权对其采取谈话提醒、书面警示、调整或者取消已批准的套期保值额度、限制开仓、限期平仓、强行平仓等措施。

第十四条 会员或者客户在进行套期保值申请和交易时，存在欺诈或者违反交易所规定的其他行为的，交易所所有权调整或者取消其套期保值额度，将其已建立的持仓予以部分或者全部强行平仓，并按照《中国金融期货交易所违规违约

《处理办法》的有关规定处理。第四章 附则 第十五条 违反本办法规定的，交易所按照本办法和《中国金融期货交易所违规违约处理办法》的有关规定处理。第十六条 本办法由交易所负责解释。第十七条 本办法自2007年6月27日起实施。中国金融期货交易所套期保值额度申请（审批）表一、申请人基本情况

| 会员名称 | 会员号 | 联系人电话 | 申请人名称 | 申请人客户号 | 联系人电话 |
|------|-----|-------|-------|--------|-------|
| | | | | | |

二、套期保值申请情况

| 合约代码 | 买/卖 | 申请数量 | 持有期限 |
|------|-----|------|------|
| | | | |

三、报送材料（另附）

- 1、自然人客户应当提交本人身份证复印件，会员或者法人客户应当提交营业执照副本复印件、组织机构代码证复印件以及近2年经过审计的资产负债表、损益表、现金流量表；
- 2、客户需要保值的现货资产持有状况的证明；
- 3、近6个月的现货交易情况；
- 4、套期保值交易方案；
- 5、历史套期保值交易情况说明；
- 6、交易所规定的其他材料。

四、申请人声明事项

- 1、提供的文件内容完整并且真实；
- 2、将依据内部稽核与内部控制程序从事期货交易；
- 3、遵守期货交易相关法律法规从事期货交易，绝不以不正当手段干扰期货与相关现货市场运作，并且了解中国金融期货交易所执行监管时，对发现的异常情况有权依据《中国金融期货交易所交易规则》及其实施细则相关规定采取相应措施以维护市场秩序；
- 4、同意中国金融期货交易所对申请人从事期货交易期间，可以依据相关规定要求申请人就有关事项限期提出书面说明或者补充文件，申请人不会规避或者拒绝。

五、申请人签章

申请人（负责人）签章： 申请人盖章： 六、会员对申请人材料真实性的声明事项

我公司保证申请人向贵所提供的各项证明材料均属实，并在运作中按照中国金融期货交易所的有关规定执行。

七、会员签章

会员负责人签章： 会

员盖章：八、交易所审批交易所审批意见：100Test 下载频道
开通，各类考试题目直接下载。详细请访问 www.100test.com