



广期所 套保业务申请指南

- 若要申请一般月/交割月的套期保值持仓额度，需要先申请套保交易资格哦！



所需材料

均需用印！

套期保值交易资格申请

1. 《广州期货交易所套期保值交易资格申请表》
(主要包括申请人基本信息、申请品种及交易所要求的其他信息)
2. 企业营业执照副本复印件或者公司注册证书等能证明经营范围的文件
3. 交易所要求的其他材料（套期保值交易资格申请承诺函、相应品种现货发票（发票日期为一年内）等）

增加一般月份套期保值持仓额度

- 1.《广州期货交易所套期保值建仓需求额度申请表》(主要包括申请人基本信息、申请品种、合约和数量及交易所要求的其他信息)
- 2.所申请品种近一年的现货或标的资产经营业绩或风险管理服务规模,及套期保值期间的经营或风险管理服务计划
- 3.交易所要求的其他材料(套期保值方案说明,主要包括风险来源分析、保值目标、预期的交割或者平仓数量等)

(申请材料可参考后续样本5-7)

增加交割月份套期保值持仓额度

- 1.《广州期货交易所套期保值建仓需求额度申请表》(主要包括申请人基本信息、申请品种、合约和数量及交易所要求的其他信息)
- 2.已持有的及拟持有的现货或标的资产证明材料及用途说明
- 3.所申请品种近一年的现货或标的资产经营业绩或风险管理服务规模,及套期保值期间的经营或风险管理服务计划
- 4.交易所要求的其他材料(套期保值方案说明,主要包括风险来源分析、保值目标、预期的交割或者平仓数量等)

(申请材料可参考后续样本5-8)

套保额度时间表

	增加一般月份套期保值持仓额度		增加交割月份套期保值持仓额度
套期保值额度申请方式	按品种方式申请	按合约方式申请	按合约方式申请
增加套期保值额度申请时间	任一交易日	截止日为套期保值合约交割月份前第一个月的最后一个交易日	截止日为套期保值合约交割月份前第一个月的最后一个交易日
增加套期保值额度使用时间	自合约上市之日起至交割月份前第一个月最后一个交易日		交割月份第一个交易日至最后交易日
增加套期保值额度审核时间	交易所在收到完整的申请材料后5个工作日内进行审核并予以答复		交易所在收到完整的申请材料后，于该合约交割月前第一个月的第一个交易日起进行审核，并在5个工作日内予以答复



注意事项

套期保值交易资格

- 套期保值交易资格申请可在全年任一交易日提出
- 交易所在收到完整材料后的5个交易日内进行审批
- 取得套期保值交易资格后，可以在相关品种的期货、期权合约上进行套期保值交易

套期保值建仓需求额度

- 未取得套期保值持仓增加额度的，套期保值持仓额度在数量上等于投机持仓限额
- 取得套期保值持仓增加额度的，套期保值持仓额度在数量上等同于投机持仓限额与套期保值持仓增加额度之和；套期保值持仓量不得超过交易所确定的套期保值持仓额度，套期保值持仓量和投机持仓量合计不得超过交易所确定的套保持仓额度
- 广期所可以将投机仓转为套保仓（需要会服申请）
- 按品种方式申请的增加一般月份套期保值持仓额度，客户自获批额度的次年起，应当在每年6月30日之前向交易所更新申请材料，逾期未更新的，相应套期保值持仓额度将失效。

以上资料仅供参考，具体以交易所规则或最新通告为准

申请资料参考

套保资格

材料1

套期保值交易资格申请表(样本)

广州期货交易所套期保值交易资格申请表

(交易编码)

填写日期: 20XX年XX月XX日

客户号	XXX	客户名称	XXX	客户联系人	XXX	客户联系电话	XXXXXXXXXXXX
会员号	0014	会员名称	信达期货	会员联系人	曾炜杰	会员联系电话	0571-28132566

申请品种	工业硅						
经营类型	<input type="radio"/> 生产	<input type="radio"/> 加工	<input checked="" type="radio"/> 贸易	<input type="radio"/> 终端消费	<input type="radio"/> 风险管理服务	<input type="radio"/> 其他	

企业盖章:



填表说明

- 1.会员应在征求客户同意的情况下,进行套期保值交易资格申请。
- 2.客户联系人应为管理企业期货头寸的套期保值交易负责人,会员联系人应为管理客户套期保值业务申请的负责人。
- 3.申请企业可以同时申请多个品种的套期保值交易资格。
- 4.申请套期保值交易资格需要提交的材料包括企业营业执照副本、申请品种的现货发票、承诺函等复印件,并加盖企业公章。

套期保值交易资格申请承诺函

广州期货交易所：

我司在办理套期保值业务时，已知晓《广州期货交易所套期保值管理办法》第二十条规定“交易所可以根据市场情况和套期保值企业的经营状况对非期货公司会员、境外特殊非经纪参与者和客户套期保值交易资格和套期保值持仓可增加的额度进行调整”，同意交易所可以视市场情况在必要时调整或取消已审核的建仓额度，并遵守交易所的其他各项规则制度。

我司承诺：

（一）当交易所认为我司持有的某合约持仓进入交割月份、或者我司在交割月份的持仓，导致或者可能导致市场发生以下情形时，我司会根据交易所相关要求及时、主动、有序地将持仓降低到该合约交割月投机持仓限额内：

1. 期货价格和对应现货商品价格的合理价差遭到破坏；
2. 近月合约与远月合约间的合理价差遭受不利影响；
3. 市场流动性显著降低；
4. 交易所规定的其他情形。

（二）当我司出现未申报实际控制关系账户等违规情形时，我司会根据交易所相关要求及时、主动、有序地将持仓降到投机持仓限额内。

（三）定期、按时、主动提交交易所要求的与套期保值相关的业务材料。

（四）遵守交易所关于套期保值管理的其他规则制度及监管要求。

公司名称：XXXX

日期：20XX年XX月XX日

公★章


证明经营范围的文件(样本)

(以企业营业执照副本为例)

[illegible]

材料4

增值税发票(样本)

<div style="text-align: center;">  </div>										发票代码: 发票号码: 开票日期: 校验码:		
机器编号:												
购买方名称: 纳税人识别号: 地址、电话: 开户行及账号:		密 码 区										
项目名称			规格型号		单位	数 量	单 价		金 额		税率	税 额
合 计												
价税合计 (大写)			(小写)									
销 售 方 名 称: 纳税人识别号: 地 址、电 话: 开户行及账号:		备 注										
收 款 人:				复 核:				开 票 人:				

套保额度(一般月/交割月)

材料5

套期保值建仓需求额度申请表(样本)

广州期货交易所套期保值建仓需求额度申请表
(适用品种模式，仅供会员单位参考)

(交易编码)

填写日期: 20XX 年 XX 月 XX 日

客户号	XXX	客户名称	XXX	客户联系人	XXX	客户联系电话	XXXXXXXXXX
会员号	0014	会员名称	信达期货	会员联系人	曾炜杰	会员联系电话	0271-28132566
品种				套期保值建仓需求额度			
工业硅				2000			

企业盖章:

填表说明

- 1.客户联系人应为管理企业期货头寸的套期保值交易负责人，会员联系人应为管理客户套期保值业务申请的负责人。
- 2.申请企业可以同时申请多个按品种模式管理的期货品种的一般月份套期保值建仓需求额度。

公章

广州期货交易所套期保值建仓需求额度申请表
(适用合约模式，仅供会员单位参考)

(交易编码)

填写日期: 20XX 年 XX 月 XX 日

客户号	XXX	客户名称	XXX	客户联系人	XXX	客户联系电话	XXXXXXXXXX
会员号	0014	会员名称	信达期货	会员联系人	曾炜杰	会员联系电话	0271-28132566
合约	套期保值类型			买/卖方向	套期保值建仓需求额度		
PS2505	一般月份套期保值			卖	2000		

企业盖章:

填表说明

- 1.客户联系人应为管理企业期货头寸的套期保值交易负责人，会员联系人应为管理客户套期保值业务申请的负责人。
- 2.套期保值类型分为一般月份套期保值、交割月份套期保值。其中，一般月份套期保值额度可以使用至交割月份前一个月最后交易日，交割月份套期保值额度可以使用至交割月份的最后交易日。
- 3.申请企业可以同时申请按合约模式管理的期货品种多个合约的一般月份套期保值建仓需求额度，但只能同时申请同一种一个合约的交割月份套期保值建仓需求额度。

公章

现货经营业绩及计划(样本)

(以贸易为例)

现货经营业绩及计划

(仅供会员单位参考)

(一般月份及交割月份套期保值适用)

经营模式1：生产

经营年度	经营品种	数据类型 (经营业绩/经营计划)	经营数量

本表统计生产企业在经营年度内生产及销售套保商品的数量，数量单位为手。

经营模式2：加工

经营年度	经营品种	数据类型 (经营业绩/经营计划)	经营数量

本表统计加工企业在经营年度内采购及加工套保商品的数量，数量单位为手。

经营模式3：贸易

经营年度	经营品种	数据类型 (经营业绩/经营计划)	经营数量
20XX	工业硅	经营业绩	5000
20XX	工业硅	经营计划	5000

本表统计贸易企业在经营年度内采购及销售套保商品的数量，数量单位为手。

经营模式4：终端消费

经营年度	经营品种	数据类型 (经营业绩/经营计划)	经营数量

本表统计终端消费企业在经营年度内采购及使用套保商品的数量，数量单位为手。

截至20XX年XX月XX日，本公司持有工业硅品种货数量为10000吨。


企业盖章：



套期保值方案说明(样本)

(一般月份及交割月份套期保值适用)

填写日期: 20XX 年 XX 月 XX 日

套期保值方案说明 (包括风险来源分析、 保值目标、预期的交割 或者平仓数量等)	XX
填表说明	申请企业应使用具体数据,反映现货市场与期货市场的情况,说明申请增加一般月份或交割月份套期保值额度的原因。
企业盖章:	

交割月额度的申请材料还需要:

现货持有情况及用途说明(样本)

(交割月份套期保值适用)

填写日期: 20XX 年 XX 月 XX 日

现货证明材料类型	数量 (吨)	证明材料编号
现货仓单		
自有仓库的库存	10000	
已签订合同尚未交货的采购量		
已签订合同尚未交货的销售量		
填表说明	1. 申请企业应填写符合广州期货交易所交割品质的现货数量，并提供相应的证明材料，如第三方仓库的现货仓单、采购及销售合同等。 2. 申请企业应使用具体数据，反映现货市场与期货市场的情况，说明申请增加交割月份套期保值额度的原因。	
企业盖章:		



交易所的 监督与管理



客户套期保值持仓与投机持仓合计超过交易所规定标准的，应当在下一交易日第二小节交易结束前自行调整；逾期末进行调整或调整后仍不符合要求的，交易所可以强行平仓。

对于超仓进入交割月份的，交易所可以对其采取谈话提醒、书面警示、调整或者取消套期保值持仓额度、取消套期保值交易资格、限制开仓等措施。



具有套期保值交易资格的客户有下列情形之一的，交易所可以对其采取谈话提醒、书面警示、调整或者取消其套期保值持仓增加额度、取消套期保值交易资格，必要时可以采取限制开仓、限期平仓、强行平仓等措施，并按《广州期货交易所违规违约处理办法》的有关规定处理：

（一）使用套期保值属性的交易指令频繁进行开平仓交易，且无法说明正当理由的；

（二）交易行为不符合经济合理性或者期现匹配要求，且无法说明正当理由的；

（三）交易所认定的其他不符合套期保值目的的情形。



客户在申请套期保值交易资格，申请增加套期保值持仓额度和交易时，有欺诈或违反交易所规定行为的，交易所可以不受理其增加套期保值持仓额度的申请、调整或者取消套期保值持仓额度、取消套期保值交易资格，必要时可以采取限制开仓、限期平仓、强行平仓等处置措施，并按《广州期货交易所违规违约处理办法》的有关规定处理。



始于信 達于行



信达期货有限公司



杭州 - 钱江世纪城 - 天人大厦19-20F



套期保值业务联系部门：交易风控部



套期保值业务联系电话：0571-28132566