

# 大商所

## 套保业务申请指南



- 若要申请增加一般月/交割月的套期保值持仓额度  
需要先申请套保资格哦！

### 所需材料

均需用印！

#### 套保交易资格

- 1. 《大连商品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  
(申请苯乙烯、液化石油气、纯苯品种套保资格需提供合法、有效的危险化学品经营许可证)
- 3. 交易所要求的其他材料(相应品种现货发票(发票日期一年内)、承诺函)

(申请材料可参考后续样本1-4)

#### 增加一般月份额度

- 1. 《大连商品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. 《企业现货经营业绩及计划》  
(所申请品种近一年的现货生产经营或风险管理服务规模，套期保值期间的现货生产经营或风险管理服务计划)
- 3. 交易所要求的其他材料(套期保值交易方案说明，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)

## 增加交割月份额度

- 1. 《大连商品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证明材料及用途说明
- 3. 所申请品种近一年的现货生产经营或风险管理服务规模，套期保值期间的现货生产经营或风险管理服务计划
- 4. 交易所要求的其他材料(套期保值交易方案说明；证明交割月份套期保值交易需求的真实性材料、交货能力或接货能力证明，如加工订单、购销合同、仓单、库存证明、拥有实物的其他证明等)

## 套保额度时间表

	一般月份套期保值额度		交割月份套期保值额度
套期保值申请方式	合约方式 (仅生猪和鸡蛋)	品种方式 (除生猪和鸡蛋外其他品种)	合约方式
增加套期保值额度申请时间	合约挂牌日至交割月份前一个月的倒数第5个交易日	全年任一交易日	合约挂牌日至交割月份前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

### 套保交易资格

- 套期保值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个交易日内进行审核并予以答复。当日收市前审批通过的套期保值资格，客户可在下一个交易日进行套期保值交易
- 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

### 增加套期保值额度

- 按品种方式申请增加一般月套期保值持仓额度的，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。
- 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同于投机持仓限额；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期保值持仓额度。
- 大商所可以将某品种或合约买/卖方向的投机持仓全部转换为套期保值持仓（需要会服申请）
- 存在实际控制关系账户组的客户，应各自申请套期保值交易资格。如果组内各个客户分别提出套期保值持仓额度，则该实际控制关系账户组的套期保值持仓额度为各个客户套期保值持仓额度之和。实际控制关系账户组内客户额度可以通用，仅由一个客户提出持仓额度申请即可
- 交割月份和一般月份的套期保值额度均可重复使用

以上资料仅供参考，具体以交易所规则或最新通告为准

# 申请材料参考

## 套保交易资格

### 材料1

### 套期保值交易资格申请表(样本)

#### 大连商品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	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	0571-28132566
申请品种	豆粕						
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： <div>公★章</div>							
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。						

## 证明经营范围的文件(样本)

[illegible]

## 相应品种现货发票(样本)

××增值税电子专用发票										发票代码:					
										发票号码:					
										开票日期:					
										校验码:					
机器编号:															
名称:															
纳税人识别号:															
地址、电话:															
开户行及账号:															
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)			
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:					



## 承诺函 (产业客户)

大连商品交易所：

我司在申请套期保值资格和额度时，已知晓《大连商品交易所套期保值管理办法》相关规定“交易所可以根据套期保值企业的生产经营或风险管理服务情况，对其采取调整或者取消套期保值持仓额度、取消套期保值交易资格等措施。交易所可以根据市场情况对非期货公司会员、境外特殊非经纪参与者和客户的套期保值持仓额度进行调整”。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和监管要求。

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、有序地将持仓降低到投机持仓限额内。

（三）按交易所要求提交对应品种生产经营情况、资信情况及期货交易、衍生品交易、现货交易等市场交易情况，并确保提交材料的真实性。



客户盖章：

日期：20XX年XX月XX日

增加一般月份额度

材料5

套期保值建仓需求额度申请表(样本)

(适用鸡蛋、生猪品种)

大连商品交易所套期保值建仓需求额度申请表  
(仅供会员单位参考)

(交易编码)

(鸡蛋、生猪品种一般月份套期保值; 所有品种交割月份套期保值适用)

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	0571-28132566
合约		套期保值类型		买/卖方向		套期保值建仓需求额度	
1h2501		一般月份套期保值		买		1000	

企业盖章:

填表说明

- 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。
- 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。
- 申请企业可以同时申请鸡蛋、生猪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品种一个合约的交割月份套期保值建仓需求额度。

材料6

套期保值建仓需求额度申请表(样本)

(适用鸡蛋、生猪以外品种)

大连商品交易所套期保值建仓需求额度申请表  
(仅供会员单位参考)

(交易编码)

(适用鸡蛋、生猪以外品种一般月份套期保值)

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	0571-28132566
品种		买/卖方向	套期保值建仓需求额度 (手)				
豆粕		买	2000				

企业盖章:

填表说明

- 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。
- 申请企业可以同时申请多个品种(鸡蛋、生猪品种除外)的一般月份套期保值建仓需求额度。

(以贸易为例)

企业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	经营年度	经营品种	数据类型 (经营业绩/经营计划)	经营数量 (手)
生产				
加工				
贸易	20XX	豆粕	经营计划	300000
终端消费				
风险管理服务				
其他_____				

填表说明：  
经营模式为生产的，统计企业在经营年度内生产及销售套保商品的数量；  
经营模式为加工的，统计企业在经营年度内采购及加工套保商品的数量；  
经营模式为贸易的，统计企业在经营年度内采购及使用套保商品的数量；  
经营模式为终端消费的，统计企业在经营年度内采购及使用套保商品的数量；  
经营模式为风险管理服务的，统计企业在经营年度内开展风险管理服务业务涉及套保商品的数量；  
经营模式为其他的，请备注具体业务类型，统计企业在经营年度内开展相关业务涉及套保商品的数量。

截至 20XX 年 XX 月 XX 日，本公司持有 豆粕 品种现货数量为 XXX 吨  
(原木、纤维板数量单位为立方米，胶合板数量单位为张，其他品种数量单位为吨)

企业盖章：



(一般月份套期保值适用)

套期保值方案说明  
(包括风险来源分析、  
保值目标、预期交割或  
平仓的数量等)

[illegible]

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套期保值额度的原因。

企业盖章:



增加交割月份额度

材料9

套期保值建仓需求额度申请表(样本)

大连商品交易所套期保值建仓需求额度申请表

(仅供会员单位参考)

(交易编码)

(鸡蛋、生猪品种一般月份套期保值;所有品种交割月份套期保值适用)

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	0571-28132566
合约		套期保值类型		买/卖方向		套期保值建仓需求额度	
m2501		交割月份套期保值		买		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鸡蛋、生猪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品种一个合约的交割月份套期保值建仓需求额度。

材料10

企业现货持有情况及用途说明(样本)

企业现货持有情况及用途说明

(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		
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	2000	

套期保值方案

1. 风险来源分析: XX
2. 保值目标: XX
3. 预期交割数量及价位: XX
4. 预期平仓数量及价位: XX
5. 其他: XX

填表说明

1. 填写现货数量时, 原木、纤维板数量单位为立方米, 胶合板数量单位为张, 其他品种数量单位为吨。
2. 申请企业应填写符合大连商品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。
3. 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:

(以贸易为例)

企业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	经营年度	经营品种	数据类型 (经营业绩/经营计划)	经营数量 (手)
生产				
加工				
贸易	20XX	豆粕	经营计划	300000
终端消费				
风险管理服务				
其他_____				

填表说明：  
经营模式为生产的，统计企业在经营年度内生产及销售套保商品的数量；  
经营模式为加工的，统计企业在经营年度内采购及加工套保商品的数量；  
经营模式为贸易的，统计企业在经营年度内采购及使用套保商品的数量；  
经营模式为终端消费的，统计企业在经营年度内采购及使用套保商品的数量；  
经营模式为风险管理服务的，统计企业在经营年度内开展风险管理服务业务涉及套保商品的数量；  
经营模式为其他的，请备注具体业务类型，统计企业在经营年度内开展相关业务涉及套保商品的数量。

截至 20XX 年 XX 月 XX 日，本公司持有 豆粕 品种现货数量为 XXX 吨  
(原木、纤维板数量单位为立方米，胶合板数量单位为张，其他品种数量单位为吨)

企业盖章： 



(以购销合同为例) (非固定格式)

## 商品销售合同

卖方合同编号: XXXXXXXX

买方: XXXX 公司

卖方: XXXX 公司

根据《中华人民共和国民法典》及其他有关法律、法规的规定,甲、乙双方经友好协商,在平等、自愿、公平、诚信、守法的原则下签订本合同,以资共同遵守。

## 一、交易商品及交付日期

商品名称	规格	数量	单价	总额

## 二、合同价款及付款方式

XX

## 三、商品质量

XX

## 四、其他事项

XX

买方: XXXX 公司

授权代表(签字): XXX

签订日期: 20XX 年 XX 月 XX 日

公★章

卖方: XXXX 公司

授权代表(签字): XXX

公★章



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



始于信 达于行