

企业套期保值交易方案

(交割月份套期保值适用)

填写日期:

套期保值方案	1. 风险来源分析: 2. 保值目标: 3. 预期交割数量及价位 (或期现价差, 应注明现货价格地点): 4. 预期平仓数量及价位 (或期现价差, 应注明现货价格地点): 5. 其他:
企业承诺	本企业保证上述信息真实。 本企业承诺: 当交易所认为我司持有该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。 申请企业盖章:
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, 说明申请增加交割月份套期保值额度的原因。	

