

# 附件 1 :

## 中国金融期货交易所套期保值与套利额度申请表 (股指期货)

一、申请人基本情况			
申请人名称	(交易编码对应名称)	申请日期	
套期保值客户号		套利客户号	
会员简称		会员号	
会员联系人		会员联系人电话	
托管行联系人	(QFII 填写)	托管行联系人电话	
申请人联系人		申请人联系人电话	
投资经理	(特殊单位客户填写)	投资经理电话	
产品名称		*****股指期货 (例: 沪深 300 股指期货)	
二、套期保值额度申请情况 <sup>①</sup>			
买/卖	调整前额度	调整后额度	
买			
卖			
三、申请人用于套期保值交易对应的股东账号			
上海证券交易所			
深圳证券交易所			
其他			
四、套利额度申请情况 <sup>①</sup>			
买/卖	调整前额度	调整后额度	
买			
卖			
五、申请人用于套利交易对应的股东账号			
上海证券交易所			
深圳证券交易所			
其他			
六、套期保值与套利额度申请对应资产信息 <sup>②</sup>			
资产明细	资产金额 (另附证明材料)		

统计日期	
1.现金类	
2.流通 A 股	
3.债券	
4.基金	(交易所交易的基金)
	(非交易所交易的基金)
5.其他金融类资产	(注明资产名称)
	(注明资产名称)
	(注明资产名称)
资产总计	(1)至(5)之和
资产净值	基金、证券公司资产管理计划、信托计划填写
注①：买卖额度均需填写，首次申请的调整前额度填 0。	
注②：客户填写资产信息时,资产统计日期距离申请日不超过 10 个交易日。	
<b>七、申请人声明事项</b>	
<p>1、提供的文件内容完整并且真实；</p> <p>2、将依据内部稽核与内部控制程序从事期货交易；</p> <p>3、遵守期货交易相关法律法规从事期货交易，绝不以不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在执行监管时，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；</p> <p>4、同意中国金融期货交易所在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。</p>	
<p>申请人负责人（或被授权人）签章：</p>    <p>申请人盖章：</p>	
<b>八、会员对申请人材料真实性的声明事项</b>	
<p>我公司保证申请人向贵所提供的各项证明材料均属实，同意向交易所提交相关申请，并在运作中按照中国金融期货交易所的有关规定执行。</p>	
<p>会员负责人（或被授权人）签章：</p>    <p>会员盖章：</p>	

# 中国金融期货交易所套期保值与套利额度申请表

## (国债期货)

一、申请人基本情况					
申请人名称	(交易编码对应名称)		申请日期		
套期保值客户号			套利客户号		
会员简称			会员号		
会员联系人			会员联系人电话		
托管行联系人	(QFII 填写)		托管行联系人电话		
申请人联系人			申请人联系人电话		
投资经理	(特殊单位客户填写)		投资经理电话		
产品名称		*****国债期货 (例: 5 年期国债期货)			
二、套期保值额度申请情况 <sup>①</sup>					
			买/卖	调整前额度	调整后额度
产品额度			买		
			卖		
临近交割月份合约额度	合约号		买	--	
			卖	--	
三、申请人用于套期保值交易对应的债券账号					
上海证券交易所					
深圳证券交易所					
中央国债登记结算有限责任公司					
上海清算所					
其他					
四、套利额度申请情况 <sup>①</sup>					
			买/卖	调整前额度	调整后额度
产品额度			买		
			卖		
临近交割月份合约额度	合约号		买	--	
			卖	--	
五、申请人用于套利交易对应的债券账号					
上海证券交易所					
深圳证券交易所					
中央国债登记结算有限责任公司					
上海清算所					
其他					

六、套期保值与套利额度申请对应资产信息 <sup>②</sup>		
资产明细	资产金额（另附证明材料）	
统计日期		
1.现金类		
2.债券	不含持有到期账户的可交割国债规模	
	其他	
3.其他金融类资产	(注明资产名称)	
	(注明资产名称)	
	(注明资产名称)	
资产总计	(1)至(3)之和	
注①：买卖额度均需填写，首次申请的调整前额度填0。		
注②：客户填写资产信息时,资产统计日期距离申请日不超过10个交易日。		
七、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在执行监管时，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在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。		
<p style="text-align: center;">申请人负责人（或被授权人）签章：</p>   <p style="text-align: center;">申请人盖章：</p>		
八、会员对申请人材料真实性的声明事项		
<p>我公司保证申请人向贵所提供的各项证明材料均属实，同意向交易所提交相关申请，并在运作中按照中国金融期货交易所的有关规定执行。</p>		
<p style="text-align: center;">会员负责人（或被授权人）签章：</p>   <p style="text-align: center;">会员盖章：</p>		

## 附件2：

### 套期保值与套利历史交易情况说明

历史交易情况说明报告应论述客户本阶段<sup>1</sup>套期保值与套利交易情况,包括但不限于:实际策略执行情况,交割情况,套期保值与套利交易效果,交易合规性说明等。以下为具体要求论述内容。

#### 一、套期保值交易频率说明

请结合指南中关于“套期保值不得频繁开平仓交易”要求,论述本阶段套期保值额度交易频率使用情况。

#### 二、交易策略说明

(一)请结合指南中关于“套期保值交易策略监管要求”,论述本阶段套期保值交易策略情况。

投资替代需求请结合期货交易明细,论述投资替代需求执行情况,重点说明期货持仓合约价值与有价证券市值之和不超过资产规模;

风险管理需求请论述风险管理需求执行情况,重点说明期货头寸使用与产品风险管理需求相符合,额度使用不超过产品风险管理的实际需求。

---

1: 本阶段指上次申请至本次申请期间。

风险对冲需求请论述期现匹配情况，可参照表 1 至表 4 的模板论述。

表 1：股指期货期现匹配情况表 1

交易策略 1	日期 <sup>2</sup> (列举每月最大持仓日信息)	期现匹配情况								备注
	股指期货卖持仓合约价值		卖方 向累 计持 仓合 约价 值	标的买入的现货持仓市值				现货 资产 类型	现货 持仓 对应 的股 东账 号	
	套期保 值卖持 仓合约 价值	套利净 卖方向 持仓合 约价值		沪深 300 指数 成分 股	中 小 板 股 票	创 业 板 股 票	其 他			
交易策略 2	日期 <sup>3</sup> (列举每月最大持仓日信息)	期现匹配情况								备注
	股指期货卖持仓合约价值		卖方 向累 计持 仓合 约价 值	标的买入的现货持仓市值				现货 资产 类型	现货 持仓 对应 的股 东账 号	
	套期保 值卖持 仓合约 价值	套利净 卖方向 持仓合 约价值		沪深 300 指数 成分 股	中 小 板 股 票	创 业 板 股 票	其 他			
交易策略.....	日期 <sup>4</sup> (列举每月最大持仓日信息)	期现匹配情况								备注
	股指期货卖持仓合约价值		卖方 向累 计持 仓合 约价 值	标的买入的现货持仓市值				现货 资产 类型	现货 持仓 对应 的股 东账 号	
	套期保 值卖持 仓合约 价值	套利净 卖方向 持仓合 约价值		沪深 300 指数 成分 股	中 小 板 股 票	创 业 板 股 票	其 他			

2：请列举每月卖方向累计持仓合约价值最大持仓日信息。  
 3：请列举每月卖方向累计持仓合约价值最大持仓日信息。  
 4：请列举每月卖方向累计持仓合约价值最大持仓日信息。

表 2：股指期货期现匹配情况表 2

交易策略 1	日期 <sup>5</sup> (列举 每月最大 持仓日 信息)	期现匹配情况						备注	
		套利 净买 方向 持仓 合约 价值	标的卖出的现货持仓市值				现货 资产 类型		现货 持仓 对应 的股 东账 号
			沪深 300 指 数 成 分 股	中 小 板 股 票	创 业 板 股 票	其 他			

  

交易策略 2	日期 <sup>6</sup> (列举 每月最大 持仓日 信息)	期现匹配情况						备注	
		套利 净买 方向 持仓 合约 价值	标的卖出的现货持仓市值				现货 资产 类型		现货 持仓 对应 的股 东账 号
			沪深 300 指 数 成 分 股	中 小 板 股 票	创 业 板 股 票	其 他			

  

交易策 略.....	日期 <sup>7</sup> (列举 每月最大 持仓日 信息)	期现匹配情况						备注	
		套利 净买 方向 持仓 合约 价值	标的卖出的现货持仓市值				现货 资产 类型		现货 持仓 对应 的股 东账 号
			沪深 300 指 数 成 分 股	中 小 板 股 票	创 业 板 股 票	其 他			

表 3：国债期货期现匹配情况表 1

日期 <sup>8</sup> (列举每月最大持仓日信息)	期现匹配情况 1						备注
	国债期货卖持仓合约价值		卖方向 累计持 仓合 约 价值	标的买 入的 现 货 持 仓 市 值	现货资 产类 型	现货持 仓对 应的 债 券 账 号	
	套期保 值卖持 仓合 约	套利净 卖方 向 持 仓 合 约					

5：请列举每月套利净买方向持仓合约价值最大持仓日信息。

6：请列举每月套利净买方向持仓合约价值最大持仓日信息。

7：请列举每月套利净买方向持仓合约价值最大持仓日信息。

8：请列举每月卖方向累计持仓合约价值最大持仓日信息。

	价值	约价值					

表 4：国债期货期现匹配情况表 2

日期 <sup>9</sup> (列举每月最大持 仓日信息)	期现匹配情况 2				备注
	套利净买方向 持仓合约价值	标的卖出的现 货持仓市值	现货资产类型	现货持仓 对应的债 券账号	

## (二) 套利交易策略说明

请详细说明套利交易策略情况，包括交易同时性，资产匹配情况等。

如果客户根据不同交易策略,或有不同小组分别进行交易的，请按策略或小组分别列出交易策略执行情况。

如果本阶段有多次套期保值、套利交易行为，请按每次套期保值、套利交易行为分别论述。

## 三、其他说明

交易情况说明不限于以上内容，客户可根据实际情况增加相关描述以进一步反应套期保值、套利交易情况。如建仓时机、交割月头寸管理、风险管理效果以及影响套期保值、套利效果的风险处理等；套期保值与套利交易的重大事项；特殊法人客户需补充符合主管部门要求的说明。

9：请列举每月套利净买方向持仓合约价值最大持仓日信息。