（上接A11版）

第三十条　从事信息增值服务业务的机构对信息进行的增值开发应当仅限于信息服务的目的。未经交易所事先书面同意，信息增值服务机构不得为信息服务以外的任何目的进行增值开发。

第四章　信息使用

第三十一条　终端用户是指向交易所授权的信息服务机构订购交易信息服务的信息最终接收者。终端用户只能从交易所授权的信息服务机构处获取交易信息。

第三十二条　信息服务机构应当与终端用户签订书面协议，协议内容应当明确规定终端用户应当遵守本办法有关规定，以及终端用户盗接、转接交易信息的处罚措施及应负的责任。信息服务机构应当将其签订的用户协议报交易所备案。

第三十三条　交易所查询终端用户信息的，信息服务机构应当立即提供其与用户签订的协议副本及该用户的相关信息。

第三十四条　信息服务机构应当编制信息设备使用明细表并报送交易所，有新增或者变动的应当于每月7日前报送交易所。传输至境外的，应当按照其与交易所约定的时间编制境外使用说明书报送交易所。

第三十五条　信息服务机构应当通过用户协议要求其用户承诺其接收的信息仅供自身使用，不得将交易信息出售或者转让他人，或者以任何方式进行再传播。

信息服务机构应当防止其用户未经交易所授权，以任何方式将交易信息进行再传播，或者将交易信息提供给他人进行再传播。

信息服务机构应当协助交易所对其用户进行监管，不得规避或者拒绝履行协助义务。

第三十六条　发现或者认为可能存在针对交易所信息的侵权行为的，信息服务机构应当立即通知交易所，协助交易所展开调查，并配合交易所针对侵权行为采取包括诉讼在内的法律措施。

第五章　收费标准

第三十七条　从事与交易信息有关的信息传播和信息增值服务业务的，应当按照交易所规定的收费标准缴纳费用。

第三十八条　交易所可以根据实际情况变更收费项目和收费标准。

第三十九条　交易所根据有关规定和市场情况，区分法定披露信息和非法定披露信息，并根据不同档次或者深度的实时、延时、每日、每周、每月、每年等交易信息，以及各类统计信息和合约历史数据库确定不同的收费标准。

第六章　监督管理

第四十条　对未经交易所许可，擅自发布、传输和传播交易信息的机构和个人，交易所有权终止其接收、传输和传播交易所信息，要求信息传播服务机构对其进行屏蔽，并追究其法律责任。

对未经交易所许可，擅自对交易信息进行增值开发的机构和个人，交易所有权要求其停止增值开发，禁止其使用增值开发成果，要求信息传播服务机构对其进行屏蔽，并追究法律责任。

交易所要求信息传播服务机构对上述机构和个人进行屏蔽的，信息传播服务机构应当立即执行。

第四十一条　信息服务机构应当将约定的增值开发成果向交易所备案。未履行备案义务的，交易所有权终止向其提供交易信息，要求信息传播服务机构对其进行屏蔽，并可根据已签署的交易信息经营许可协议进行处理。

第四十二条　已获交易所许可传播和增值开发信息的机构违反本办法的，交易所根据已签署的交易信息经营许可协议进行处理。

第四十三条　交易所会员使用、传播交易所信息的，除遵守本办法有关规定外，还应当遵守《中国金融期货交易所会员管理办法》的有关规定。

第四十四条　交易所会员违反本办法的，交易所将根据《中国金融期货交易所违规违约处理办法》以及相关协议进行处理。

第七章　附　则

第四十五条　本办法由交易所负责解释。

第四十六条　本办法自2007年6月27日起实施。

中国金融期货交易所实时行情（表式）

合约名称	合约月份	最新价	涨跌	成交量	持仓量	申买价	申卖价	申买量	申卖量	结算价	开盘价	收盘价	最高价	最低价	前结算价

注：价格：指数点；交易量、持仓量：手（按照单边计算）；涨跌：最新价与前结算价之差。

中国金融期货交易所每日行情（表式）　年　月　日　星期

合约名称	合约月份	开盘价	最高价	最低价	收盘价	前结算价	结算价	涨跌	成交量	持仓量	持仓量变化	成交额
小计												
小计												
小计												
小计												
总计												

注：价格：指数点；交易量、持仓量：手（按照单边计算）；成交额：万元（按照单边计算）；涨跌：收盘价与前结算价之差。

中国金融期货交易所每周行情（表式）　年　月　日　星期

合约名称	合约月份	周开盘价	最高价	最低价	周收盘价	涨跌	持仓量	持仓量变化	周末结算价	成交量	成交额
小计											
小计											
小计											
小计											
总计											

注：价格：指数点；成交量、持仓量：手（按照单边计算）；成交额：亿元（按照单边计算）涨跌：周收盘价与上周末结算价之差。

中国金融期货交易所每月行情（表式）　年　月

合约名称	合约月份	月开盘价	最高价	最低价	月末收盘价	涨跌	持仓量	持仓量变化	月末结算价	成交量	成交额
小计											
小计											
小计											
小计											
总计											

注：价格：指数点；成交量、持仓量：手（按照单边计算）；成交额：亿元（按照单边计算）；涨跌：月收盘价与上月末结算价之差。

中国金融期货交易所信息服务业务申请表

信息服务机构名称		信息服务机构证书号（交易所填）	
组织机构代码证			
营业执照号		席位号	
税务登记号		注册资本	
公司地址（邮编）			
传真		Email	
联系人	姓名	联系电话	手机号码
现有客户群体			
信息服务基础设施			
终端收费控制说明			
附件	一、法定代表人或者负责人身份证件； 二、工商行政管理部门核发的营业执照； 三、组织机构代码证； 四、经会计师事务所审核的最近一个会计年度的财务报告； 五、特许行业者需附主管机关的许可证照； 六、交易所要求提供的其他材料。		
申请人及负责人或者法定代表人签章			

中国金融期货交易所风险控制管理办法

第一章　总　则

第一条　为加强期货交易风险管理，保护期货交易当事人的合法权益，保障中国金融期货交易所（以下简称交易所）期货交易的正常进行，根据《中国金融期货交易所交易规则》，制定本办法。

第二条　交易所风险管理实行保证金制度、价格限制制度、持仓限额制度、大户持仓报告制度、强行平仓制度、强制减仓制度、结算担保金制度和风险警示制度。

第三条　交易所、会员和客户应当遵守本办法。

第二章　保证金制度

第四条　交易所实行保证金制度。保证金分为结算准备金和交易保证金。

第五条　股指期货合约最低交易保证金标准为10%。期货交易过程中，出现下列情形之一的，交易所可以根据市场风险状况调整交易保证金标准，并向中国证券监督管理委员会（以下简称中国证监会）报告：

（一）期货交易出现涨跌停板单边无连续报价（以下简称单边市）；

（二）遇国家法定长假；

（三）交易所认为市场风险明显变化；

（四）交易所认为必要的其他情形。

第六条　交易所调整期货合约交易保证金标准的，在当日结算时对该合约的所有持仓按照调整后的交易保证金标准进行结算。

第七条　结算准备金的管理适用《中国金融期货交易所结算细则》的有关规定。

第三章　价格限制制度

第八条　交易所实行价格限制制度。价格限制制度分为熔断制度与涨跌停板制度。熔断与涨跌停板幅度由交易所设定，交易所可以根据市场风险状况调整期货合约的熔断与涨跌停板幅度。

第九条　股指期货合约的熔断幅度为上一交易日结算价的±6%，涨跌停板幅度为上一交易日结算价的±10%。最后交易日不设熔断机制，涨跌停板幅度为上一交易日结算价的±20%。

第十条　每日开市后，股指期货合约申报价触及熔断价格且持续5分钟的，该合约启动熔断机制。申报价触及熔断价格且持续5分钟，是指只有熔断价格的买入（卖出）申报、没有熔断价格的卖出（买入）申报，或者一有卖出（买入）申报就成交、但未打开熔断价格的情形。

（一）熔断机制启动后的连续5分钟内，该合约买卖申报在熔断价格区间内继续撮合成交。5分钟后，熔断机制终止，涨跌停板幅度生效。

（二）股指期货合约申报价触及熔断价格未持续5分钟，第一节交易结束的，第二节交易开始后重新进行熔断检查。

（三）熔断机制启动后不足5分钟，第一节交易结束的，熔断机制终止；第二节交易开始后，涨跌停板幅度生效。

（四）收市前30分钟内，不设熔断机制。熔断机制已经启动的，终止执行。

（五）每日只启动一次熔断机制。

第十一条　期货合约以熔断价格或者涨跌停板价格申报的，成交撮合实行平仓优先、时间优先的原则。

第十二条　单边市是指某一合约收市前5分钟内出现只有停板价格的买入（卖出）申报、没有停板价格的卖出（买入）申报，或者一有卖出（买入）申报就成交、但未打开停板价格的情形。

第十三条　期货合约在某一交易日（该交易日称为Dt交易日，Dt前一交易日称为Dt–1交易日，Dt后一交易日称为Dt+1交易日，依次类推，下同）出现单边市，Dt交易日为最后交易日的，则该合约直接进行交割；Dt交易日不是最后交易日的，交易所将区分下列情形采取相应措施：

（一）Dt交易日与Dt–1交易日同方向累计涨跌幅度小于16%的，Dt交易日结算时该合约的交易保证金标准按照12%收取，收取标准已高于12%的按照原标准收取。

（二）Dt交易日与Dt–1交易日同方向累计涨跌幅度大于等于16%的，交易所有权根据市场情况采取下列风险控制措施中的一种或者多种：提高交易保证金标准、限制开仓、限制出金、限期平仓、强行平仓、暂停交易、调整涨跌停板幅度、强制减仓或者其他风险控制措施。

第十四条　期货合约Dt+1交易日未出现单边市，Dt+1交易日结算时交易保证金标准按照正常标准收取。

第四章　持仓限额制度

第十五条　交易所实行持仓限额制度。持仓限额是指交易所规定会员或者客户可以持有的、按照单边计算的某一合约持仓的最大数量。

第十六条　同一客户在不同会员处开仓交易，其在某一合约的持仓合计不得超出该客户的持仓限额。

第十七条　会员和客户的股指期货合约持仓限额具体规定如下：

（一）对客户某一合约单边持仓实行绝对数额限仓，持仓限额为600张；

（二）对从事自营业务的交易会员某一合约单边持仓实行绝对数额限仓，每一客户号持仓限额为600张；

（三）某一合约单边总持仓量超过10万张的，结算会员该合约单边持仓量不得超过该合约单边总持仓量的25%。

获批套期保值额度的会员或者客户持仓，不受前款限制。

第十八条　会员、客户持仓达到或者超过持仓限额的，不得同方向开仓交易。

第五章　大户持仓报告制度

第十九条　交易所实行大户持仓报告制度。交易所可以根据市场风险状况，公布持仓报告标准。

会员或者客户某一合约持仓达到交易所规定的持仓报告标准的，会员或者客户应当向交易所报告。客户未报告的，会员应当向交易所报告。

第二十条　会员或者客户的持仓达到交易所规定报告标准的，应当于下一交易日收市前向交易所报告。交易所有权要求会员、客户再次报告或者补充报告。

第二十一条　达到交易所规定报告标准的会员或者客户应当提供下列材料：

（一）《大户持仓报告表》，内容包括会员名称、会员号、客户名称和客户号、合约代码、持仓量、交易保证金、可动用资金等；

（二）资金来源说明；

（三）法人客户的实际控制人资料；

（四）开户材料及当日结算单据；

（五）交易所要求提供的其他材料。

第二十二条　会员应当对达到交易所规定报告标准的客户所提供的有关材料进行审核。会员应当保证客户所提供材料的真实性和准确性。

第二十三条　交易所有权对会员或者客户提供的材料进行核查。

第二十四条　客户在不同会员有持仓，且合计达到报告标准的，应当向交易所报告。客户未报告的，由交易所指定受托会员按照本办法第二十一条报送该客户的有关材料。

第六章　强行平仓制度

第二十五条　交易所实行强行平仓制度。强行平仓是指交易所按照有关规定对会员、客户持仓实行平仓的一种强制措施。

第二十六条　会员、客户出现下列情形之一的，交易所对其持仓实行强行平仓：

（一）结算会员结算准备金余额小于零，且未能在规定时限内补足；

（二）客户、从事自营业务的交易会员持仓超出持仓限额标准，且未能在规定时限内平仓；

（三）因违规、违约受到交易所强行平仓处罚；

（四）根据交易所的紧急措施应予强行平仓；

（五）其他应予强行平仓的情形。

第二十七条　强行平仓先由会员在开市后第一节交易时间内执行，交易所另有规定的除外。会员未在规定时限内执行完毕的，由交易所强制执行。

（一）会员执行

因本办法第二十六条第（一）、（二）项情形强行平仓的，强行平仓原则由会员自行确定，强行平仓结果应当符合交易所规定。

（二）交易所执行

1.因本办法第二十六条第（一）项情形强行平仓的：

其需要强行平仓的头寸，由交易所按照上一交易日结算后合约总持仓量由大到小顺序，优先选择持仓量大的合约作为强行平仓的合约，再按照该合约所有客户持仓比例分配。

交易所对多个结算会员强行平仓的，按照应当追加保证金数额由大到小的顺序依次选择强行平仓的结算会员。

2.因本办法第二十六条第（二）项情形强行平仓的：

交易所对超仓头寸进行强行平仓；客户在多个会员处持仓的，按照持仓数量由大到小的顺序选择会员强行平仓。

3.因本办法第二十六条第（三）、（四）、（五）项情形强行平仓的，交易所根据涉及的会员或者客户的具体情况确定强行平仓头寸。

当会员同时因本办法第二十六条第（一）、（二）项情形强行平仓时，交易所先按照第（二）项情形确定强行平仓头寸，再按照第（一）项情形确定强行平仓头寸。

第二十八条　强行平仓的执行程序

（一）通知

交易所以“强行平仓通知书”（以下简称通知书）的形式向有关结算会员下达强行平仓要求。通知书除交易所特别送达以外，随当日结算数据发送，有关结算会员可以通过交易所系统获得。

（二）执行及确认

1.开市后，有关会员应当自行平仓，直至符合交易所规定；

2.结算会员超过规定平仓时限而未执行完毕的，剩余部分由交易所执行强行平仓；

3.强行平仓结果随当日成交记录发送，有关信息可以通过交易所系统获得。

第二十九条　强行平仓的价格通过市场交易形成。

第三十条　因价格涨跌停板限制或者其他市场原因，无法在规定时限内完成全部强行平仓的，其剩余强行平仓数量可以顺延至下一交易日继续强行平仓，仍按照第二十七条原则执行，直至符合交易所规定。

第三十一条　因价格涨跌停板限制或者其他市场原因，无法在当日完成全部强行平仓的，交易所根据当日结算结果，对该会员做出相应处理。

第三十二条　因价格涨跌停板限制或者其他市场原因，有关持仓的强行平仓只能延时完成的，因此产生的亏损，由直接责任人承担；未能完成平仓的，该持仓持有者应当继续对此承担持仓责任或者交割义务。

第三十三条　由会员执行的强行平仓产生的盈利归直接责任人；由交易所执行的强行平仓产生的盈亏相抵后的盈利按照国家有关规定执行；因强行平仓产生的亏损由直接责任人承担。

直接责任人是客户的，强行平仓后产生的亏损，由该客户所在会员先行承担后，自行向该客户追索。

第七章　强制减仓制度

第三十四条　交易所实行强制减仓制度。强制减仓是指交易所将当日以涨跌停板价格申报的未成交平仓报单，以当日涨跌停板价格与该合约净持仓盈利客户按照持仓比例自动撮合成交。

第三十五条　强制减仓的方法

（一）同一客户双向持仓的，其净持仓部分的平仓报单参与强制减仓计算，其余平仓报单与其反向持仓自动对冲平仓。

（二）申报平仓数量的确定

申报平仓数量是指在Dt交易日收市后，已在交易所系统中以涨跌停板价格申报无法成交的、且客户合约的单位净持仓亏损大于等于Dt交易日结算价10%的所有持仓。

客户不愿按照上述方法平仓的，可在收市前撤单。

（三）客户合约单位净持仓盈亏的确定

客户合约的单位净持仓盈亏是指客户该合约的持仓盈亏的总和除以净持仓量。客户该合约持仓盈亏的总和是指客户该合约所有持仓中，Dt–2交易日（含）前成交的按照Dt–2交易日结算价、Dt–1交易日和Dt交易日成交的按照实际成交价与Dt交易日结算价的差额合并计算的盈亏总和。

（四）单位净持仓盈利客户平仓范围的确定

根据上述方法计算的单位净持仓盈利大于零的客户的盈利方向净持仓均列入平仓范围。

（五）平仓数量的分配原则

1.在平仓范围内按照盈利大小的不同分成三级，逐级进行分配。

首先分配给单位净持仓盈利大于等于Dt交易日结算价的10%的持仓（以下简称盈利10%以上的持仓）；其次分配给单位净持仓盈利小于Dt交易日结算价的10%而大于等于6%的持仓（以下简称盈利6%以上的持仓）；最后分配给单位净持仓盈利小于Dt交易日结算价的6%而大于零的持仓（以下简称盈利大于零的持仓）。

2.以上各级分配比例均按照申报平仓数量(剩余申报平仓数量)与各级可平仓的盈利持仓数量之比进行分配。

盈利10%以上的持仓数量大于等于申报平仓数量的，根据申报平仓数量与盈利10%以上的持仓数量的比例，将申报平仓数量向盈利10%以上的持仓分配实际平仓数量；

盈利10%以上的持仓数量小于申报平仓数量的，根据盈利10%以上的持仓数量与申报平仓数量的比例，将盈利10%以上的持仓数量向申报平仓客户分配实际平仓数量。再把剩余的申报平仓数量按照上述的分配方法依次向盈利6%以上的持仓、盈利大于零的持仓分配；还有剩余的，不再分配。

（六）强制减仓的执行

强制减仓于Dt交易日收市后执行，强制减仓结果作为Dt交易日会员的交易结果。

（七）强制减仓的价格

强制减仓的价格为该合约Dt交易日的涨跌停板价格。

（八）强制减仓当日结算时交易保证金标准按照正常标准收取。

按照本条进行强制减仓造成的经济损失由会员及其客户承担。

第三十六条　该合约在采取上述措施后风险仍未释放的，交易所宣布进入异常情况，并按照有关规定采取风险控制措施。

第八章　结算担保金制度

第三十七条　交易所实行结算担保金制度。结算担保金是指由结算会员依交易所规定缴存的，用于应对结算会员违约风险的共同担保资金。

第三十八条　结算担保金分为基础结算担保金和变动结算担保金。基础结算担保金是指结算会员参与交易所结算交割业务必须缴纳的最低结算担保金数额。变动结算担保金是指结算会员结算担保金中超出基础结算担保金的部分，随结算会员业务量的变化而调整。结算担保金应当以现金形式缴纳。

（一）各类结算会员的基础结算担保金为：交易结算会员人民币1000万元，全面结算会员人民币2000万元，特别结算会员人民币3000万元。结算会员在签署《中国金融期货交易所结算会员协议》后的5个交易日内，将基础结算担保金存入交易所结算担保金专用账户。

（二）交易所每季度最后一个交易日收市后，根据市场总体情况，确定全市场的结算担保金总额，通知结算会员其应当分担的结算担保金。

每个结算会员根据业务量按照比例分担结算担保金总额。结算会员应当分担的结算担保金＝结算担保金总额×（20%×该会员上一季度日均交易量／交易所上一季度日均交易量＋80%×该会员上一季度日均持仓量／交易所上一季度日均持仓量）。

结算会员应当分担的结算担保金数额与其基础结算担保金数额取大者，作为结算会员新季度应当缴纳的结算担保金数额。交易所在新季度开始的第5个交易日第一节结束后，通过银行将结算担保金余额的超出部分划至结算会员结算担保金专用账户，将需要补交的结算担保金从结算会员结算担保金专用账户中扣划。

结算会员需要补交结算担保金的，应当在新季度的第5个交易日前将补交数额存入其结算担保金专用账户。

（三）交易所可以根据市场风险情况调整结算担保金的收取时间以及结算担保金总额，并有权对个别结算会员提高结算担保金。

第三十九条　结算会员结算准备金小于零，且未能在规定时限内补足的，交易所采取强行平仓等措施后，结算准备金仍小于零，交易所先使用该违约结算会员的结算担保金补足，不足部分再按照比例使用其他结算会员缴纳的结算担保金。

其他结算会员分摊比例为其结算担保金余额占当前未使用结算担保金总额之比，分摊的金额以其缴纳的结算担保金为限。

第四十条　结算会员缴纳的结算担保金，依本办法第三十九条使用后，应于5个交易日内按照原缴纳标准，将需要补足的部分存至其结算担保金专用账户。交易所于第5个交易日第一节结束后通过银行从结算会员结算担保金专用账户中扣划。

第四十一条　结算会员未能按期缴纳、补足结算担保金的，按照《中国金融期货交易所违规违约处理办法》有关规定处理。

第四十二条　动用结算担保金后，交易所由此取得对违约会员的相应追偿权。

第九章　风险警示制度

第四十三条　交易所实行风险警示制度。交易所认为必要的，可以分别或者同时采取要求会员和客户报告情况、谈话提醒、书面警示、公开谴责、发布风险警示公告等措施中的一种或者多种，以警示和化解风险。

第四十四条　出现下列情形之一的，交易所有权约见指定的会员高管人员或者客户谈话提醒风险，或者要求会员或者客户报告情况：

（一）期货价格出现异常；

（二）会员或者客户交易异常；

（三）会员或者客户持仓异常；

（四）会员资金异常；

（五）会员或者客户涉嫌违规、违约；

（六）交易所接到涉及会员或者客户的投诉；

（七）会员涉及司法调查；

（八）交易所认定的其他情况。

第四十五条　交易所实施谈话提醒应当遵守下列要求：

（一）交易所发出书面通知，约见指定的会员高管人员或者客户谈话，客户应当由会员指定人员陪同；

（二）交易所安排谈话提醒时，应当将谈话时间、地点、要求等以书面形式提前一天通知会员；

（三）谈话对象确因特殊情况不能参加的，应当事先报告交易所，经交易所同意后可以书面委托有关人员代理；

（四）谈话对象应如实陈述、不得故意隐瞒事实；

（五）交易所工作人员应当对谈话的有关信息予以保密。

交易所要求会员或者客户报告情况的，有关报告方式和报告内容参照大户报告制度执行。

第四十六条　交易所通过情况报告和谈话，发现会员或者客户有违规嫌疑、交易头寸有较大风险的，有权对会员或者客户发出《风险警示函》。

第四十七条　发生下列情形之一的，交易所有权在指定媒体上对有关会员和客户进行公开谴责：

（一）不按照交易所要求报告情况和谈话的；

（二）故意隐瞒事实，瞒报、错报、漏报重要信息的；

（三）故意销毁违规违约证明材料，不配合交易所调查的；

（四）经查实存在欺诈客户行为的；

（五）经查实参与分仓和操纵市场的；

（六）交易所认定的其他违规行为。

交易所对相关会员或者客户进行公开谴责的同时，对其违规行为，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。

第四十八条　发生下列情形之一的，交易所有权发出风险警示公告，向全体会员和客户警示风险：

（一）期货价格出现异常；

（二）期货价格和现货价格出现较大差距；

（三）会员或者客户涉嫌违规、违约；

（四）会员或者客户交易存在较大风险；

（五）交易所认定的其他情形。

第十章　附　则

第四十九条　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。

第五十条　本办法由交易所负责解释。

第五十一条　本办法自2007年6月27日起实施。

大户持仓报告表

客户名称			客户号		
联系地址			联系电话		
资金调拨人名称			资金调拨人联系电话		
指令下达人名称			指令下达人联系电话		
合约代码		买持仓量		卖持仓量	
合约代码		买持仓量		卖持仓量	
合约代码		买持仓量		卖持仓量	
合约代码		买持仓量		卖持仓量	
总持仓保证金		资金规模		实际控制人	
资金来源					
本人（公司）保证以上报告内容的真实性，不存在任何故意隐瞒或者遗漏。 报告人签名：　　报告日期：　年　月　日					
以下由客户所属会员填写					
本公司保证客户在我处持仓大小的真实性，不存在任何隐瞒或者遗漏。 会员单位盖章：　　年　月　日					
会员名称		会员号			
客户开户日期		客户交易方式			
IP地址		电话委托号码			
经审核，本公司保证本报告所有内容的真实性，不存在任何隐瞒或者遗漏。 会员单位盖章：　　报告日期：　年　月　日					

中国金融期货交易所套期保值管理办法

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。			
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：			