

套期保值、套利额度申请材料核查单

会员名称

申请日期:

一、申请人基本情况			
客户名称	(交易编码对应名称)	客户号	
客户类型	自然人客户 <input type="checkbox"/> 一般单位客户 <input type="checkbox"/> 特殊单位客户 <input type="checkbox"/> 特殊单位客户类型: (与统一开户系统投资者类型保持一致)		
客户交易类型			
客户资产规模			
二、套期保值、套利额度申请情况			
产品名称		(例: 沪深 300 股指期货)	
买/卖	原额度	申请额度	会员测算额度
买			
卖			
三、申请材料核查项目 (请在选项上打√)			
1、申请材料是否完整, 签章是否齐备			是 否
2、客户是否准确填报了用于套期保值、套利交易对应的股东账号			是 否
3、是否为特殊单位客户 (非特殊单位客户的, 不涉及 (1)、(2) 核查项)			是 否
(1) 特殊单位客户是否符合监管层参与指引中的交易目的要求			是 否
(2) 特殊单位客户申请的额度是否符合监管层规定的参与指引要求			是 否
4、客户资产证明是否由第三方开具 (除证券自营客户)			是 否
5、客户的资产证明文件统计时间距离申请日是否在规定的 10 个交易日内			是 否
6、套保交易方案是否包括了以下内容			
(1) 套保策略			是 否
(2) 现货规模与套保额度需求测算			是 否

(3) 期现资产关联度分析	是 否
(4) 交割月头寸管理	是 否
7、套利交易方案是否包括了以下内容	
(1) 套利策略	是 否
(2) 现货规模与套利额度需求测算	是 否
(3) 交易系统情况	是 否
(4) 交割月头寸管理	是 否
8、是否按照审核要求进行额度测算	
(1) 测算使用的合约价值：(万元)	是 否
(2) 测算日期：	
(3) 客户资产规模/合约价值=(四舍五入至整数位)	
9、其他需要核查的材料	
(1)	是 否
(2)	
(3)	
套保套利业务经办人签字：	
套保套利业务负责人签字：	