

大连商品交易所套保套利管理系统操作手册

通过阅读该用户手册，会员单位业务人员可以了解大连商品交易所会员服务子系统的套保套利相应功能相应操作方法。

1. 套期保值管理

1.1 套期保值交易资格管理

1.1.1 套期保值交易资格申请

- 1) 点击左侧菜单“套期保值管理->套期保值交易资格管理->套期保值交易资格申请”，打开页面如图例 1.1.1-1：



图例 1.1.1-1

- 2) 会员点击【同意】按钮，进入如下图所示套期保值交易资格申请录入页面，其中红色*号为必填项，会员在申请套期保值交易资格的同时可进行经营规模与品种模式套期保值

建仓需求额度的申请，填写完信息点击【提交】按钮，如图例 1.1.1-2：

套期保值交易资格申请录入

客户号:	00000098 *	经营类型:	<input type="checkbox"/> 生产 <input type="checkbox"/> 加工 <input type="checkbox"/> 出口 <input type="checkbox"/> 其他 *
品 种:	聚丙烯 1 *	其他:	<input type="text"/>
客户联系人:	11 *	客户联系电话:	11 *
会员联系人:	11 *	会员联系电话:	11 *
上传附件:	<input type="text" value="D:\Users\dev2_tester0\桌面..."/> *		

经营规模

年 份:	未选择 *	x年经营业绩:	<input type="text"/> 手
x年经营计划:	<input type="text"/> 手	x年经营业绩:	<input type="text"/> 手

套期保值建仓需求额度申请

合同期限:	一般月份	模 式:	品种模式
套期保值建仓需求额度:	<input type="text"/> 手	上传附件:	<input type="text"/> 浏览...

申请填写说明:

1. 红色字体为必填项。
2. 如需申请额度, 必须先填写经营规模, 且上框额度申请附录。
3. 仅支持品种模式下的建仓需求额度申请, 合约模式下的建仓需求额度申请请完成资格申请后在合约模式需求额度申请功能申请。
4. 工作附录请将1-24项全部勾选, 且不超过20项。由于带宽限制, 工作附录可能逐项校验, 请耐心等待。

套期保值交易资格管理

- 套期保值交易管理
- 套期保值交易资格管理
- 套期保值交易资格申请
- 套期保值交易资格申请管理
- 套期保值交易资格审核明细查询
- 套期保值交易资格删除明细查询
- 套期保值交易资格删除申请
- 套期保值交易资格汇总查询
- 经营规模或需求额度管理
- 套期保值查询

图例 1.1.1-2

3) 填写完信息点击【提交】按钮，进入如下图所示信息确认页面，在确认页面中，会显示录入的信息，同时显示客户号对应的客户名称，如果会员发现信息有误可点击【重填】按钮返回图例 1.1.1-2 套期保值交易资格申请录入页面重新录入申请信息，确认信息无误点击【确认】按钮，打开页面如图例 1.1.1-3：

图例 1.1.1-3

- 4) 如果确认完成点击【确定】按钮, 确认并提交申请, 进行验签确认, 套期保值交易资格申请流程结束。

1.1.2 套期保值交易资格申请管理

- 1) 点击左侧菜单“套期保值管理->套期保值交易资格管理->套期保值交易资格申请管理”, 在“套期保值交易资格申请管理”页面, 录入查询条件, 品种为所有上市品种(不含已摘牌), 默认值为全部, 日期类型为申请日期, 查询条件录入完成后, 点击【查询】按钮, 查询出符合条件的套期保值交易资格申请录入信息(仅当会员提交申请后, 且交易尚未对该笔申请进行锁定前, 该笔申请可以通过此功能点进行查询), 如图例 1.1.2-1:

序号	客户号	客户名称	品种	计划年份 (手)	经营计划 (手)	业绩年份 (手)	合约期间 (手)	申请额度 (手)	申请日期	状态	操作
1	00000008	张XX	鸡蛋	1	1	1	1	1	20170601	审批中	修改 删除

图例 1.1.2-1

- 2) 会员可以对查询出的申请进行修改或删除, 如果会员想取消申请, 可以点击【删除】按钮对该笔申请进行删除; 如果会员想修改申请, 可以点击【修改】按钮对该笔申请进行修改, 进入“套期保值交易资格申请录入修改”页面, 在此页面下, 其中红色*号为必填项, 如图例 1.1.2-2:



图例 1.1.2-2

- 3) 如果确认完成点击【提交】按钮, 确认并提交申请, 系统记录修改后的套期保值交易资格申请。如果取消修改, 点击【返回】按钮, 系统记录修改前的套期保值交易资格申请。

1.1.3 套期保值交易资格审批明细查询

- 1) 点击左侧菜单“套期保值管理->套期保值交易资格管理->套期保值交易资格审批明细查询”, 录入查询条件, 品种为所有上市品种(不含已摘牌), 默认值为全部, 审批状态默认值为全部, 日期类型分为申请日期和审批日期, 默认为申请日期, 审批状态默认为全部, 查询条件录入完成后, 点击【查询】按钮, 查询出符合条件的套期保值交易资格审批明细信息, 如图例 1.1.3-1:



图例 1.1.3-1

- 2) 在“审批明细查询”页面，可点击【查看】按钮，查看详细明细信息。

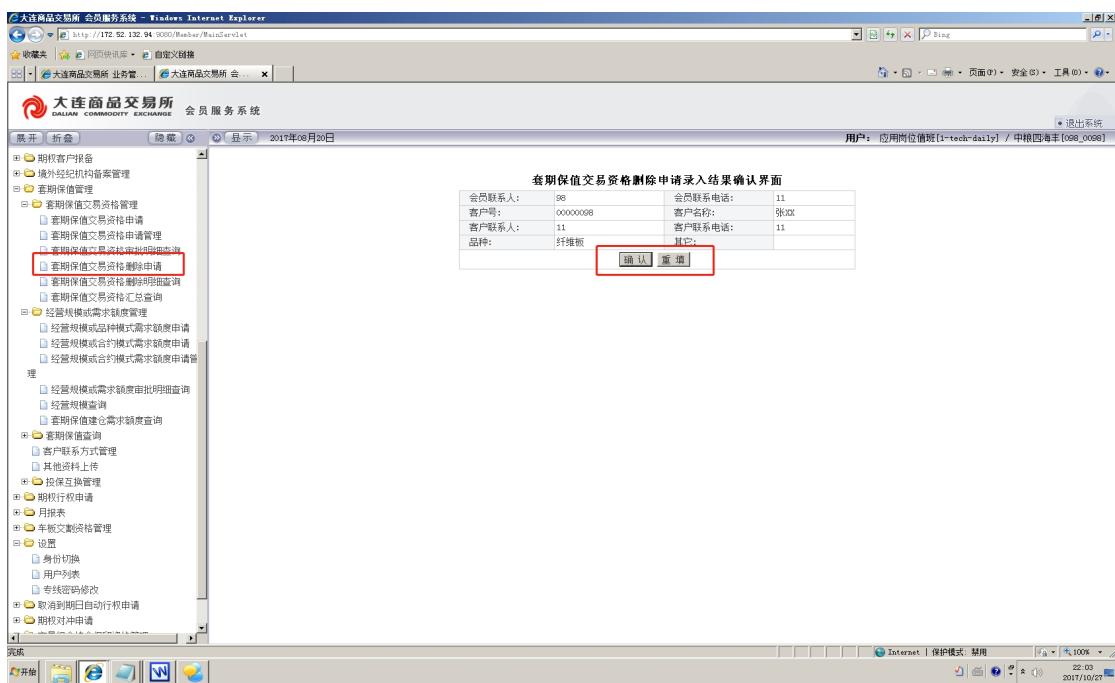
1.1.4 套期保值交易资格删除申请

- 1) 点击左侧菜单“套期保值管理->套期保值交易资格管理->套期保值交易资格删除申请”，进入信息录入页面，会员在此功能点下对已获得套期保值交易资格的客户进行删除资格申请，其中红色*号为必填项，如图例 1.1.4-1：



图例 1.1.4-1

2) 信息录入完成后, 点击【提交】按钮, 进入录入结果确认界面, 如果确认完成点击【确认】按钮, 系统提交删除申请。如果需要修改信息, 点击【重置】按钮返回图例 1.1.4-1 套期保值交易资格删除申请页面, 重新输入信息。如图例 1.1.4-2:



图例 1.1.4-2

1.1.5 套期保值交易资格删除明细查询

点击左侧菜单“套期保值管理->套期保值交易资格管理->套期保值交易资格删除明细查询”，进入信息录入页面，点击【查询】按钮，查询出符合条件的套期保值交易资格删除信息，点击【查看】按钮，可查询详细信息。如图例 1.1.5-1：



图例 1.1.5-1

1.1.6 套期保值交易资格汇总查询

点击左侧菜单“套期保值管理->套期保值交易资格管理->套期保值交易资格汇总查询”，进入信息录入页面，点击【查询】按钮，查询出符合条件的套期保值交易资格信息。如图例 1.1.6-1：



图例 1.1.6-1

1.2 经营规模或需求额度管理

1.2.1 经营规模或品种模式需求额度申请

- 1) 点击左侧菜单“套期保值管理->经营规模或需求额度管理->经营规模或品种模式需求额度申请”，打开页面如图例 1.2.1-1:



图例 1.2.1-1

2) 进入“经营规模或品种模式需求额度申请”页面，红色*号为必填项，会员可选择单独或同时申请经营规模、需求额度，当仅申请需求额度时，需确保客户已具有相应品种有效经营规模。品种为所有上市品种（不含已摘牌），合约期间为一般月份，当申请需求额度时，需通过上传附件将情况说明上传，录入完成后，点击【提交】按钮。如图例

1.2.1-2



图例 1.2.1-2

3) 进入经营规模或品种模式需求额度新增确认页面,如果会员发现信息有误可点击【重填】

按钮返回图例 1.2.1-2 页面重新录入申请信息, 确认信息无误点击【确认】按钮, 打开页面如图例 1.2.1-3:



经营规模或品种模式需求额度新增

申请信息	
品种	纤维板
客户号:	00000088
客户联系人:	11
会员联系人:	11
经营规模	
计划年份:	2017
业绩年份:	2016
合约模式需求额度	
合约期间:	一般月份
套期保值建仓需求额度:	11手
上传附件:	周报系统优化.rar

确认 重填

图例 1.2.1-3

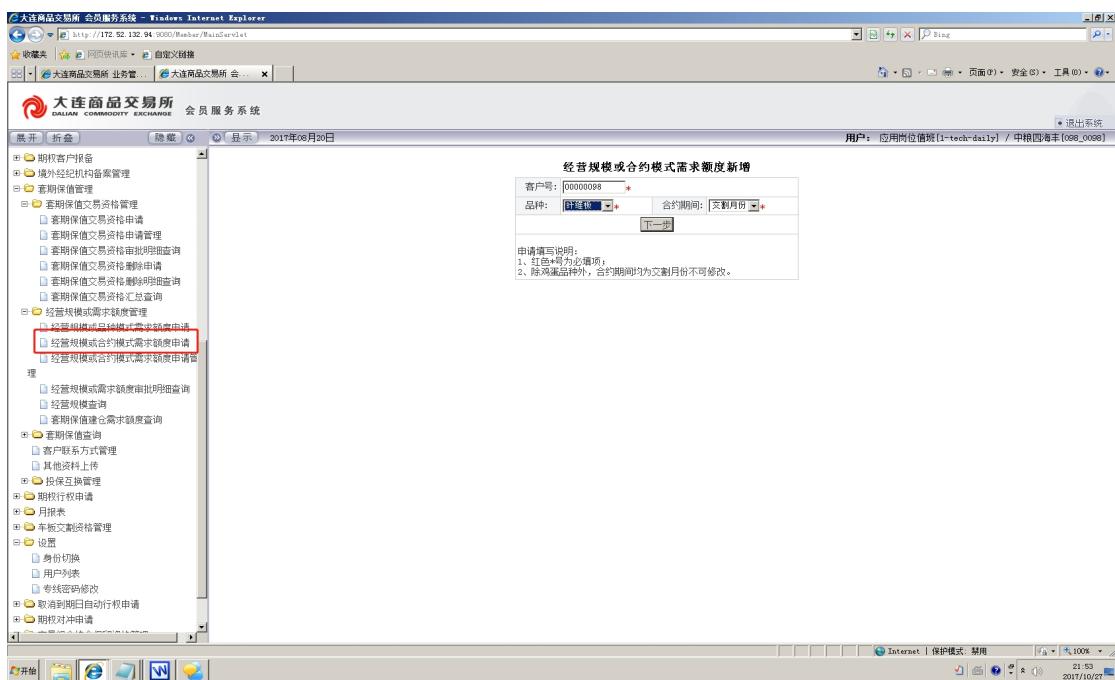
1.2.2 经营规模或合约模式需求额度申请

1) 点击左侧菜单“套期保值管理->经营规模或需求额度管理->经营规模或合约模式需求额度申请”, 打开页面如图例 1.2.2-1:



图例 1.2.2-1

- 2) 进入“经营规模或合约模式需求额度新增”页面，红色*号为必填项，输入信息后，点击【下一步】按钮。如图例 1.2.2-2



图例 1.2.2-2

- 3) 进入“经营规模或合约模式需求额度新增”页面，红色*号为必填项，会员可选择单独申请需求额度或同时申请经营规模、需求额度，仅申请需求额度时，需确保客户已具有相应品种有效经营规模。输入信息后，点击【提交】按钮。如图例 1.2.2-3

图例 1.2.2-3

4) 进入额度新增申请确认页面,如果会员发现信息有误可点击【重填】按钮返回图例 1.2.2-2

页面重新录入申请信息,确认信息无误点击【确认】按钮,如图例 1.2.2-4:

图例 1.2.2-4

1.2.3 经营规模或合约模式需求额度申请管理

1) 点击左侧菜单“套期保值管理->经营规模或需求额度管理->经营规模或合约模式需求额

度申请管理”，录入查询条件，品种为所有上市品种（不含已摘牌），默认值为全部，日期类型为申请日期，查询条件录入完成后，点击【查询】按钮，查询出符合条件的申请信息（仅当会员提交申请后，且交易所未对该笔申请进行锁定前，该笔申请可以通过此功能点进行查询），如图例 1.2.3-1：

序号	客户号	客户名称	品种	计划年份	经营计划(手)	业务年份	经营业务(手)	合约	买卖方向	申请日期	查询保值建仓需求额度	客户联系人	客户联系电话	会员联系人	会员联系电话	状态	操作
1	00000098	张XX	周一	2017	1111	2018	11111	al707	买	20170801	11	11	11	11	11	审核中	修改

图例 1.2.3-1

- 2) 会员可以对查询出的申请进行修改或删除，如果会员想取消申请，可以点击【删除】按钮对该笔申请进行删除；如果会员想修改申请，可以点击【修改】按钮对该笔申请进行修改，进入“经营规模或合约模式建仓需求额度修改”页面，在此页面下，其中红色*号为必填项，如图例 1.2.2-2：

图例 1.2.2-2

3) 如果确认完成点击【提交】按钮, 确认并提交申请, 系统记录修改后的申请。

1.2.4 经营规模或需求额度审批明细查询

点击左侧菜单“套期保值管理->经营规模或需求额度管理->经营规模或需求额度审批明细查询”, 录入查询条件, 品种为所有上市品种(不含已摘牌), 默认值为全部, 合约期间分为一般月份与交割月份, 默认值为全部, 日期类型为申请日期与审批日期, 默认值为申请日期, , 买卖方向默认为全部, 查询条件录入完成后, 点击【查询】按钮, 查询出符合条件的申请信息, 如图例 1.2.4-1:



图例 1.2.4-1

1.2.5 经营规模查询

点击左侧菜单“套期保值管理->经营规模或需求额度管理->经营规模查询”，录入查询条件，品种为所有上市品种（不含已摘牌），默认值为全部，计划年份默认空值，查询条件录入完成后，点击【查询】按钮，查询出符合条件的客户经营规模信息，如图例 1.2.5-1：



图例 1.2.5-1

1.2.6 套期保值建仓需求额度查询

点击左侧菜单“套期保值管理->经营规模或需求额度管理->套期保值建仓需求额度查询”，录入查询条件，品种为所有上市品种（不含已摘牌），默认值为全部，合约期间分为一般月份与交割月份，默认值为全部，买卖方向默认为全部，查询条件录入完成后，点击【查询】按钮，查询出符合条件的客户需求额度信息，如图例 1.2.6-1：



序号	客户号	客户名称	品种	计划年份	经营计划 (手)	业绩年份	业绩 (手)
1	00000098	张XX	豆一	2017	11	2016	1111
2	00000098	张XX	豆二	2018	77777	2017	0
3	00000098	张XX	玉米	2017	100000	2016	8000
4	00000098	张XX	纤维板	2017	1111	2016	1111
5	00000098	张XX	豆粕	2017	11111111	2016	11111111
6	00000098	张XX	棕榈油	2017	5000	2016	10000
7	00000098	张XX	聚氯乙烯	2018	5000	2017	5000
8	00000098	张XX	豆油	2017	5000	2016	10000

图例 1.2.6-1

1.3 套期保值查询

1.3.1 一般月份套期保值额度查询

点击左侧菜单“套期保值管理->套期保值查询->一般月份套期保值额度查询”，录入查询条件，品种为所有上市品种（不含已摘牌），默认值为全部，查询条件录入完成后，点击【查询】按钮，查询出符合条件的客户一般月份套期保值额度信息，如图例 1.3.1-1：



图例 1.3.1-1

1.3.2 交割月份套期保值额度查询

点击左侧菜单“套期保值管理->套期保值查询->交割月份套期保值额度查询”，录入查询条件，品种为所有上市品种（不含已摘牌），默认值为全部，查询条件录入完成后，点击【查询】按钮，查询出符合条件的客户交割月份套期保值额度信息，如图例 1.3.2-1:



图例 1.3.2-1

1.4 客户联系方式管理

点击左侧菜单“套期保值管理->客户联系方式管理”，录入客户号或直接点击【查询】按钮，显示查询结果，在查询结果页面，选择一条记录，点击【修改】按钮，可对客户信息进行修改。如图例 1.4-1：



图例 1.4-1

1.5 其他资料上传

点击左侧菜单“套期保值管理->其他资料上传”，红色*号为必填项，信息录入完成后点击【提交】按钮。如图例 1.5-1：

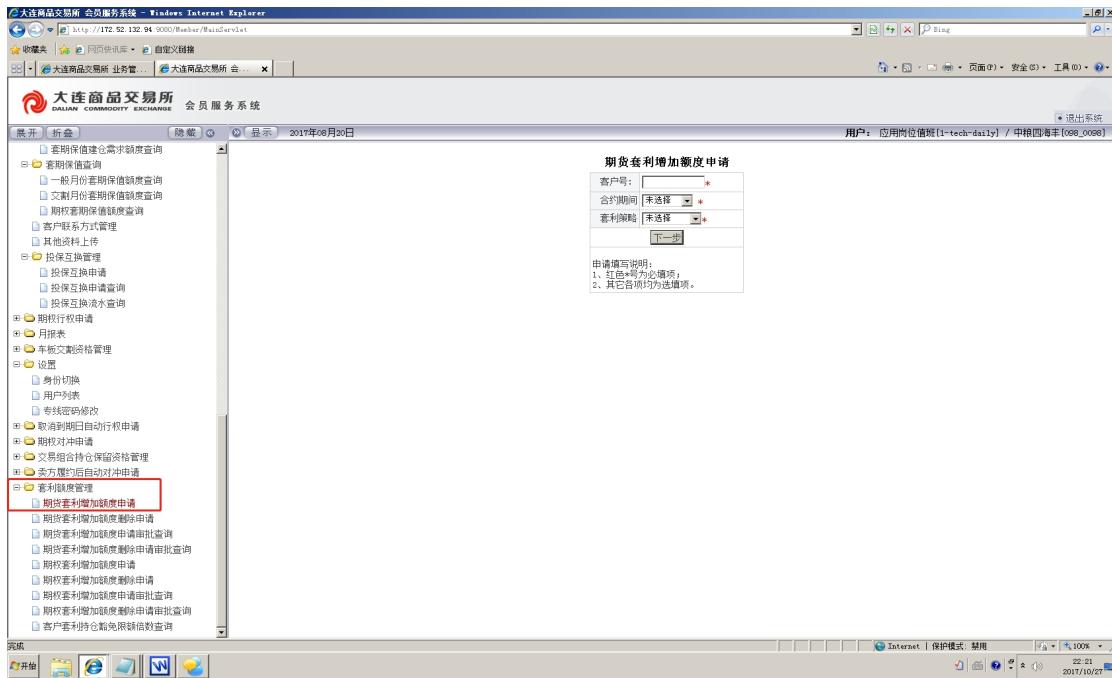


图例 1.5-1

2. 套利额度管理

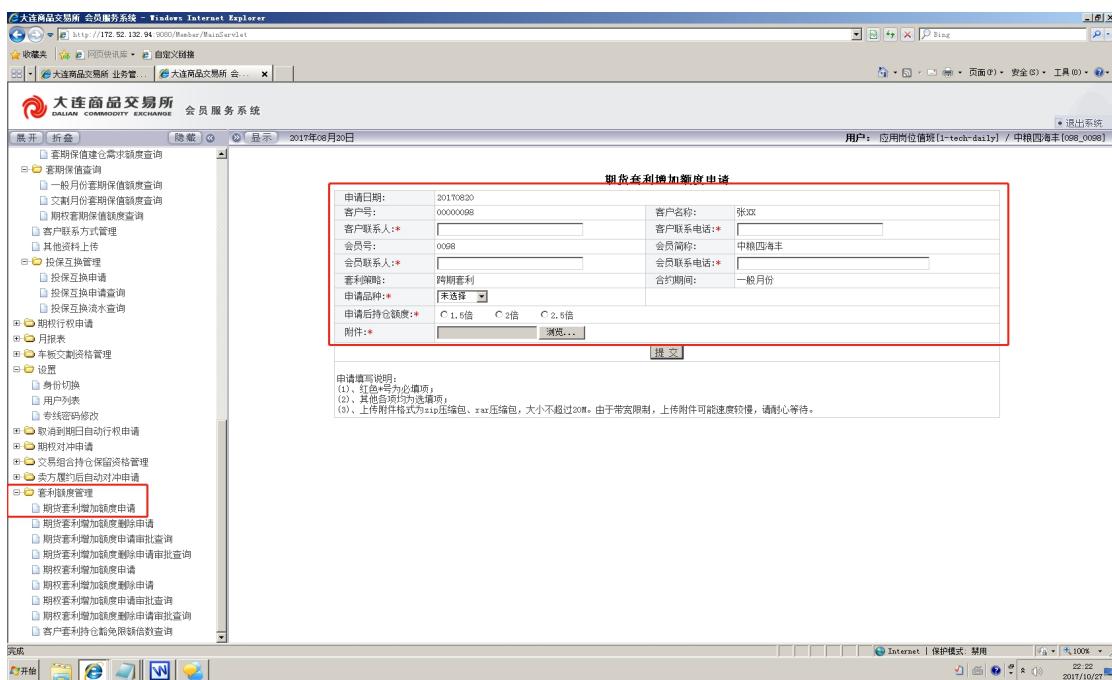
2.1 期货套利增加额度申请

- 1) 点击左侧菜单“套利额度管理->期货套利增加额度申请”，红色*号为必填项，信息录入完成后点击【下一步】按钮，打开页面如图例 2.1-1:



图例 2.1-1

2) 进入“期货套利增加额度申请”页面，红色*号为必填项，信息录入完成后点击【提交】按钮，打开页面如图例 2.1-2:



图例 2.1-2

2.2 期货套利增加额度删除申请

点击左侧菜单“套利额度管理->期货套利增加额度删除申请”，红色*号为必填项，信息录入

完成后点击【查询】按钮，查询出符合条件的信息，选中一条或多条信息进行删除操作，打开页面如图例 2.2-1：



图例 2.2-1

2.3 期货套利增加额度申请审批查询

点击左侧菜单“套利额度管理->期货套利增加额度申请审批查询”，信息录入完成后点击【查询】按钮，查询出符合条件的信息，打开页面如图例 2.3-1：



图例 2.3-1

2.4 期货套利增加额度删除申请审批查询

点击左侧菜单“套利额度管理->期货套利增加额度删除申请审批查询”，信息录入完成后点击【查询】按钮，查询出符合条件的信息，打开页面如图例 2.4-1：

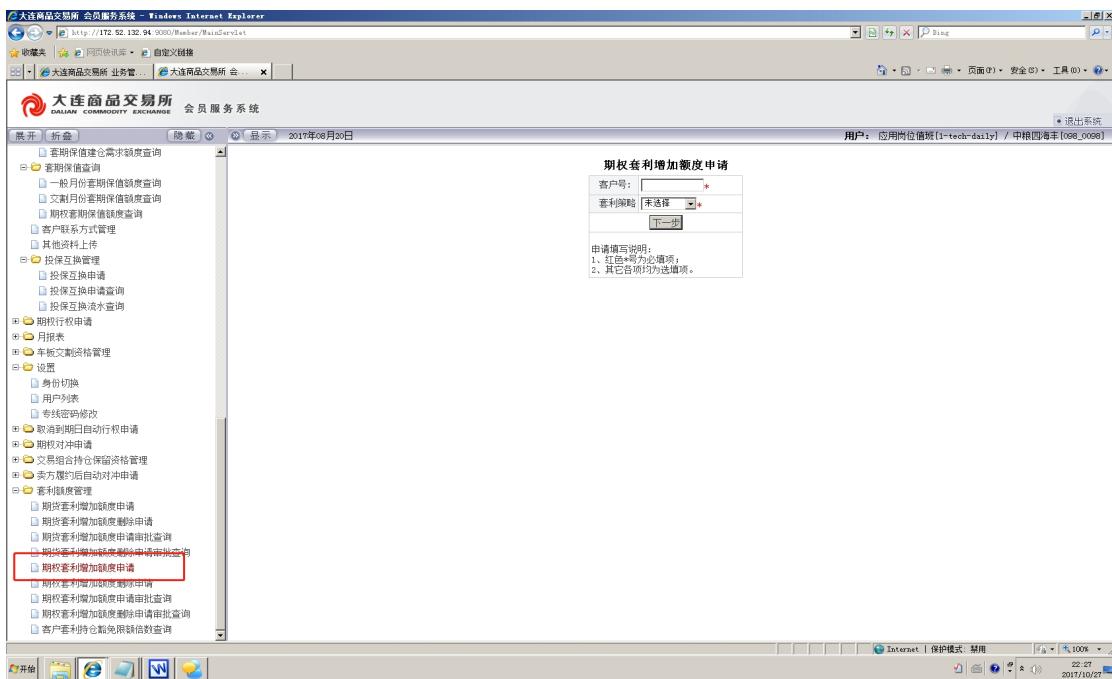


序号	申请日期	客户号	客户名称	客户联系人	客户联系电话	会员号	会员简称	会员联系人	会员联系电话	合同期限	套利策略	申请品种1	申请合约1	审批后持仓额度1	申请品种2	申请合约2
1	20170601	00000008	张XX	11	11	0008	0008有限公司简称	11	11	一般月份	跨期套利	玉米淀粉		1.5		
2	20170619	00000098	张XX	99	99	0008	0008有限公司简称	99	99	一般月份	跨期套利	焦煤		1.5		

图例 2.4-1

2.5 期权套利增加额度申请

1) 点击左侧菜单“套利额度管理->期权套利增加额度申请”，红色*号为必填项，信息录入完成后点击【下一步】按钮，打开页面如图例 2.5-1：



图例 2.5-1

2) 进入“期权套利增加额度申请”页面，红色*号为必填项，信息录入完成后点击【提交】按钮，打开页面如图例 2.5-2：



图例 2.5-2

2.6 期权套利增加额度删除申请

点击左侧菜单“套利额度管理->期权套利增加额度删除申请”，红色*号为必填项，信息录入

完成后点击【查询】按钮，查询出符合条件的信息，选中一条或多条信息进行删除操作，打开页面如图例 2.2-1：



图例 2.6-1

2.7 期权套利增加额度申请审批查询

点击左侧菜单“套利额度管理->期权套利增加额度申请审批查询”，信息录入完成后点击【查询】按钮，查询出符合条件的信息，打开页面如图例 2.7-1：



图例 2.7-1

2.8 期权套利增加额度删除申请审批查询

点击左侧菜单“套利额度管理->期权套利增加额度删除申请审批查询”，信息录入完成后点击【查询】按钮，查询出符合条件的信息，打开页面如图例 2.8-1：



图例 2.8-1

2.9 客户套利持仓豁免限倍数查询

点击左侧菜单“套利额度管理->客户套利持仓豁免限倍数查询”，红色*号为必填项，信息录入完成后点击【查询】按钮，查询出符合条件的信息，打开页面如图例 2.9-1：



图例 2.9-1