附件5

**2022年**

**“大商所农保计划”**

**项目计划书**

项目名称：

项目类型：□大豆振兴项目

申请单位：

负 责 人：

起止时间：

大连商品交易所印制

**目录**

1. 项目背景

申报目的、项目历史、项目现状及预期效果。

1. 参与主体

**（一）服务主体**

主体名称、性质、地点、种植面积、亩产、参与意愿等，提供证明材料（如营业执照等）作附件。

**（二）保险公司**

公司名称、性质、资质、实力、项目经验等，提供证明材料（如营业执照、资质许可等）作附件。

**（三）期货公司及关联方**

申报主体名称、性质、参与资质，提供证明材料（如营业执照、资质许可等）作附件。

**（四）政府参与**

项目地政府参与情况、建立的合作机制等，提供证明材料作附件。

**（五）合作机制**

参与方合作机制、工作计划等，可提供证明材料作附件。

1. 基本要素信息（可根据实际情况增加信息）

|  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- |
| 类别 | 项目 | 情况 | 类别 | 项目 | 情况 |
| 项目信息 | 现货量 |  | 项目信息 | 保险责任期 |  |
| 目标亩产 |  | 保险责任水平 |  |
| 历史亩产 |  | 总保费 |  |
| 目标价格 |  | 总权利金 |  |
| 目标收入 |  | 费率 |  |
| 面积 |  | 总保额 |  |
| 合作社数 |  | 采价期 |  |
| 农户数 |  | 服务主体自缴保费 |  |
| 建档立卡贫困户数 |  | 政府补贴保费 |  |
| 是否有银行参与 |  | 其他渠道补贴保费 |  |
| 银行信贷情况 |  | 需交易所支持金额 |  |
| 是否存在保底赔付 |  | 保底赔付金额 |  |

1. 基本内容

**（一）项目模式**

**（二）项目品种、区域及规模**

**（三）具体流程方案（可用流程图）**

**（四）保险产品设计及费率厘定**

**（五）与保险产品对应的场外期权产品设计及定价**

|  |  |
| --- | --- |
| 期货公司 |  |
| 保险公司 |  |
| 地区 | XX省XX市XX县（区） |
| 品种 | 大豆 |
| 标的合约 |  |
| 波动率 |  |
| 现货量 |  |
| 产品起始日 | 格式：2022/1/1 |
| 产品到期日 | 格式：2022/1/1 |
| 采价期 | 格式：2022/1/1-2022/1/31 |
| 客户买入/卖出 |  |
| 欧式/美式/亚式等 |  |
| 看涨/看跌/价差等 |  |
| 入场价格 | 元/吨 |
| 执行价格 | 元/吨 |
| 简单/组合/奇异等 |  |
| 行权条件 |  |
| 权利金率 |  |
| 备注 |  |

**（包括但不限以上内容，写明定价测算过程）**

**（六）对冲方式及策略（举例说明）**

**（七）预估项目操作期间场内对冲量**

**（八）项目的风险评估及对应措施**

1. 现有条件

衍生品团队建设、历史成果和研究方法等。

1. 时间安排

各流程进度时间安排。

1. 经费预算

|  |  |  |
| --- | --- | --- |
| **开支项目** | **金额（元）** | **用途说明** |
|  |  |  |
|  |  |  |
|  |  |  |
| **合计** |  |  |

附件：1...

2...

**牵头单位（公章）：**

**负责人签章：**

**年 月 日**

**参与单位（公章）：**

**负责人签章：**

**年 月 日**