申请竞价做市商业务内容说明要点

|  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- |
| **说明 事项** | **业务内容** | | **建议部分说明要点** |
| 做市业务实施方案 | 1 | 做市业务总体设想 | 投入做市业务的资金规模、运用，及人员投入的详细情况 |
| 2 | 做市策略 | 定价模型，不同情况下的报价策略、对冲策略、头寸管理、盈利预期等 |
| 3 | 做市系统基本功能 | 系统名称、开发机构、报价模型管理、报价频率及重要业务参数管理等 |
| 内部管理制度 | 1 | 业务运行管理 | 做市业务运行管理各要素 |
| 2 | 合规与内部控制 | 授权管理机制、投资决策流程和业务隔离机制等 |
| 3 | 公司对做市业务的监督管理 | 公司层面对做市业务的监督管理措施等 |
| 4 | 额度管理 | 公司内部关于做市持仓限额、资金及用汇额度申请流程等 |
| 5 | 岗位设置与工作职责 | 做市业务相关部门、岗位人员及其职责 |
| 风险控制制度 | 1 | 保证金管理 | 保证金监控、盈亏管理 |
| 2 | 市场风险管理 | 隔夜风险管理、市场大幅波动与极端市况风险管理等 |
| 3 | 交易管理 | 头寸管理、交易和风险敞口的限额、交割管理，合理性检查、授权权限等前端控制 |
| 4 | 模型风险管理 | 模型失效下的应对等 |
| 5 | 流动性风险管理 | 流动性风险的应对等 |
| 6 | 预警设置 | 持仓限额、每秒报单数量等 |
| 7 | 技术风险管理 | 技术系统的风险种类、处理方式等 |
| 8 | 压力测试及报告 | 不同场景（含极端情况）下的保证金、收益及报价情况的压力测试 |
| 应急预案 | 1 | 突发事件 | 突发事件的情形的分类及分析 |
| 2 | 预警及响应机制 | 预警机制、响应机制及内部流程 |
| 3 | 应急处理方式 | 各类应急处理预案及内部流程 |