

附件 2

# 豆粕期权做市业务指南

大连商品交易所

2017 年 3 月

# 目 录

说明及声明.....	3
第一章 总体要求.....	4
一、概述.....	4
二、基本要求.....	4
第二章 资格管理.....	6
一、做市商申请条件.....	6
二、做市商审核程序.....	7
三、做市商退出机制.....	7
第三章 业务办理与操作流程.....	8
一、做市商资格申请流程.....	8
二、做市交易编码申请及报备流程.....	11
三、做市交易编码变更流程.....	13
四、做市商基本情况变更报备流程.....	14
五、提高持仓限额申请流程.....	14
六、申请放弃做市商资格流程.....	15
七、做市商异常交易管理要求.....	15
八、变更做市交易编码或失去做市商资格相关规定.....	16
第四章 义务和权利.....	16
一、做市商报价义务.....	17
二、做市商报价义务免除情形.....	19
三、做市商权利.....	20
四、做市商排名和末位淘汰.....	20
第五章 技术系统.....	20
一、技术系统基本要求.....	20
二、技术系统风险管理.....	21
三、信息技术制度.....	22
第六章 监督管理.....	22
一、业务隔离.....	23
二、日常监管.....	23
三、违规处理.....	23
附件 1 大连商品交易所期权做市商资格申请表.....	25
附件 2 期权做市商岗位设置与人员情况汇总表.....	26
附件 3 承诺书.....	27
附件 4 大连商品交易所期权做市商变更做市交易编码申请表.....	28
附件 5 大连商品交易所期权做市商基本情况变更报备表.....	29
附件 6 大连商品交易所增加期权持仓额度申请表.....	30
附件 7 大连商品交易所期权做市商持仓豁免承诺函.....	31
附件 8 大连商品交易所期权做市商放弃做市商资格申请表.....	32

## 说明及声明

为规范大连商品交易所（以下简称本所或交易所）期权做市商管理，根据《大连商品交易所期权交易管理办法》和《大连商品交易所期权做市商管理办法》（以下简称《管理办法》），制定本指南。本指南主要内容包括做市商的总体要求、资格管理、业务办理与操作流程、做市商权利义务、评价、技术系统、监督管理等方面。本所将根据业务规则变化和市场情况，对本指南进行持续更新和调整。本指南仅供做市商开展做市业务时参考，如有内容与本所业务规则不一致，以本所业务规则为准。做市商的权利义务等相关要求，以《管理办法》以及与本所签订的做市商协议为准。

# 第一章 总体要求

## 一、概述

做市商是指经交易所认可，为指定品种的期权合约提供双边报价等服务的单位客户。交易所可以在指定期权品种上引入做市商，并向市场公布。

做市商双边报价包括持续报价和回应报价。

（一）持续报价。在期权交易时间内，做市商按协议约定，主动提供的持续性双边报价。

（二）回应报价。在期权交易时间内，做市商按协议约定，对收到询价请求的期权合约，进行的双边报价。

做市商的报价内容包括合约代码、买入价、卖出价和双边报价数量。

做市商双边报价以限价方式申报。

## 二、基本要求

做市商必须严格遵守国家有关法律、行政法规、规章和《大连商品交易所交易规则》、《大连商品交易所期权交易管理办法》、《大连商品交易所期权做市商管理办法》和其他业务规则及其修订、变更条款。

做市商应当具有专门机构和人员负责做市业务，做市业务应当与其他业务进行有效隔离，防范利益冲突。做市商不得将做市业务委托第三方代为履行，也不得与第三方合作履行。做市人员应当熟悉期货、期权相关法律法规和交易所业务规则。做市商从事做市业务的负责人及主要相关人员应当

在中国境内从事做市业务。做市商开展期权做市业务应当有做市业务负责人，并至少需设立交易岗、风险控制岗、技术运维等岗位，并建立备岗机制。

做市商净资产应不低于人民币 5000 万元。做市商应当使用自有资金进行做市，不得以发售基金、理财、信托、资管产品等方式募集的资金或者违法违规资金开展做市业务。做市商应当具有交易所认可的豆粕期权仿真交易做市经验。最近三年无重大违法违规记录。

做市商应当制定健全的做市业务实施方案，内容包括但不限于做市业务总体规划、交易管理、定价与报价策略、对冲策略、头寸管理、资金管理、决策流程、做市系统基本功能、风险管理和内部控制措施、应急措施等，确保做市业务规范开展。

做市商应当建立严格的内部控制方案和风险管理制度，规范各项业务操作流程，确保做市业务风险可控、依法合规。内部控制方案内容包括但不限于业务运行管理、决策流程、资金管理、业务隔离机制、合规与内部监管、岗位设置与工作职责等以及有关的工作流程。风险管理制度内容包括但不限于做市业务风险管理基本原则、风险指标设计、风险识别与评估、风险控制与处置、业务风险管理、市场风险管理、操作风险管理、技术系统风险管理及相关测试报告等。

做市商应当建立做市业务应急处理机制，内容包括但不限于突发事件情形、预警与响应机制、应急处理措施与流程、报告机制及事后管理等，应对期权做市业务相关的突发情况

或异常事件，保障做市业务平稳开展。

做市商应当具备稳定、可靠的做市业务技术系统，建立健全信息技术管理制度、信息系统报备制度及应急机制，按季度向交易所报告做市技术系统开发、测试、接入和升级等变化情况，并按照交易所要求参与相关测试及应急演练工作。做市业务技术系统应当具备行情、交易、风控、资金和持仓管理以及应急处置、做市义务统计等基本功能。

做市商不得利用做市业务资格进行内幕交易、市场操纵、欺诈等违法违规行为，或者谋取其他不正当利益。

## 第二章 资格管理

本所按期权品种实行做市商资格管理，做市商资格以与交易所签订做市商协议为准。交易所对期权品种指定一定数量的做市商，并可视市场情况调整做市商数量。

### 一、做市商申请条件

申请做市商资格，应当具备下列条件：

- （一）净资产不低于人民币 5000 万元；
- （二）具有专门机构和人员负责做市业务，做市人员应当熟悉期货、期权相关法律法规和交易所业务规则；
- （三）具有健全的做市业务实施方案、内部控制制度和风险管理制度；
- （四）最近三年无重大违法违规记录；
- （五）具备稳定、可靠的做市业务技术系统；

- (六) 具有交易所认可的豆粕期权仿真交易做市经验；
- (七) 中国证券监督管理委员会及交易所规定的其他条件。

## 二、做市商审核程序

本所做市商审核程序主要包括申请材料形式审核、初审评分、现场答辩、现场检查等环节，交易所根据申请机构情况进行综合评分选出指定数量的做市商。选出的申请机构在与交易所签订做市商协议后，获得豆粕期权品种做市商资格，未通过审核或逾期未签订协议的，不具备本所期权做市商资格。

## 三、做市商退出机制

### 第一类：被取消资格

做市商出现下列情形之一的，交易所所有权取消其在一期期权品种上的做市商资格：

(一) 一个自然年度内，在该期权品种上连续两个月或者累计三个月未完成报价义务；

(二) 在该期权品种年度做市评价排名中处于最末位（含并列情况），且年度日均有效持续报价时间比或年度日均有效回应询价比小于 80%；

(三) 交易所认定或者协议约定的其他情形。

做市商出现下列情形之一的，交易所所有权取消其在所有期权品种上的做市商资格：

(一) 存在违法违规行为；

(二) 被采取证券、期货市场禁止进入措施；

- (三) 不再满足《管理办法》规定的做市商资格条件；
- (四) 依法被收购、兼并、撤销、解散或者宣告破产；
- (五) 向交易所提交虚假材料；
- (六) 交易所认定或者做市商协议约定的其他情形。

被交易所取消做市商资格的，自交易所通知失去资格之日起，与该期权品种相关的做市商协议自动终止。

#### 第二类：主动申请放弃

做市商可以申请放弃做市商资格。做市商放弃某期权品种做市商资格的，应当提前一个月向交易所提出申请，自交易所通知失去资格之日起，相关做市商协议自动终止。

#### 第三类：交易所终止做市商业业务

交易所可以根据市场情况终止期权品种的做市商业业务，并向市场公布，相关做市商协议自动终止。

## 第三章 业务办理与操作流程

### 一、做市商资格申请流程

#### (一) 交易所启动做市商招募工作

根据相关工作安排，择时启动做市商资格申请流程，具体以交易所相关要求为准。

#### (二) 申请机构提交申请材料

申请豆粕期权品种做市商资格，申请机构应当向交易所提交如下申请材料：

1. 经法定代表人签章并加盖单位公章的做市商资格申请表（附件1）；



2. 加盖单位公章的营业执照、组织机构代码证的复印件；

3. 经审计的最近一期财务会计报告原件或者加盖会计师事务所公章的复印件；

4. 做市业务部门的岗位设置和职责规定，以及从事做市业务的负责人及相关人员的名单、履历；（岗位设置与人员情况汇总表详见附件 2，其中，做市业务负责人、交易岗、风险控制岗、技术开发运维岗主要人员须另附详细个人简历）

5. 申请品种做市业务实施方案、内部控制制度和风险管理制度；（做市业务实施方案内容包括但不限于做市业务总体规划、交易管理、定价与报价策略、对冲策略、头寸管理、资金管理、决策流程、做市系统基本功能、风险管理和内部控制措施、应急措施等；内部控制方案内容包括但不限于业务运行管理、决策流程、资金管理、业务隔离机制、合规与内部监管、岗位设置与工作职责等以及有关的工作流程；风险管理制度内容包括但不限于做市业务风险管理基本原则、风险指标设计、风险识别与评估、风险控制与处置、业务风险管理、市场风险管理、操作风险管理、技术系统风险管理及相关测试报告等）

6. 最近三年无重大违法违规记录的承诺书（附件 3）；

7. 做市业务技术系统情况的说明；（说明包括但不限于对行情显示、权限管理、定价与做市策略、交易管理、风险控制、资金管理、行权管理、持仓管理、做市义务统计等做

市业务技术系统基本功能的介绍，以及做市系统批量撤单、一键撤单等应急处置功能的介绍及相应使用场景，信息技术管理制度、信息系统报备制度及应急处理机制等)

8. 为期权交易或者期权仿真交易做市情况的说明；(包括但不限于本所豆粕期权仿真交易做市情况，为其他市场期权交易或期权仿真交易提供流动性等情况)

9. 交易所要求提供的其它材料。(包括但不限于公司股东、成立时间、注册地址、办公地址等基本情况的说明，期货公司风险管理子公司还需提供加盖单位公章的中国期货业协会关于做市业务备案函的复印件)

### (三) 初审评分

交易所收到申请材料后，首先进行形式审核，材料不齐全的，不能参与做市商资格评审。

材料齐全的，交易所根据《管理办法》规定及交易所有关要求，进行资格申请条件审核，不符合本所做市商资格申请条件的，不能进入下一步审核程序。符合本所做市商申请条件的，交易所进行初审评分，根据初审评分选出候选机构参与现场答辩。

### (四) 现场答辩

通过初审评分的做市商申请机构，应当根据交易所要求按时参加现场答辩，交易所根据申请机构综合情况进行打分，并根据打分情况确定入选名单。交易所将视情况组织现场检查，核实申请机构相关情况，现场检查不通过的，不能成为入选做市商。

### （五）签署做市商协议

经交易所批准后,申请机构应当在交易所要求日期内,与交易所签订做市商协议。协议签署后,申请机构正式成为做市商,具有该期权品种做市商资格。

在与交易所签订做市商协议前,做市商应当先与做市业务所在期货公司(以下简称协议期货公司)就做市有关事项达成一致意见,并随同协议将期货公司承诺函提交至交易所。

### （六）完成设备安装调试

做市商名单确定后,做市商应当及时进行设备安装调试等相关工作,确保做市业务一切准备就绪。

## 二、做市交易编码申请及报备流程

根据中国期货市场监控中心(以下简称监控中心)《特殊单位客户统一开户业务操作指引》,做市商开户比照特殊单位客户管理。做市商须为做市业务申请一个专用的做市交易编码(交易所为做市商的做市业务分配一个做市专用客户号,做市交易编码为会员号+做市专用客户号),用于履行做市义务及进行相关交易。做市交易编码可以交易做市期权品种及标的期货品种,不可用于其他品种交易,品种交易权限由交易所设置。

做市交易编码申请流程如下:

### （一）做市商信息报送

做市商应当根据交易所要求及时按下表格式将“客户名称”、“组织机构代码”、“期货公司名称”、“期货公司编码”等

信息报至交易所，交易所在统一开户系统中进行做市商信息报备。

统一开户系统校验的做市商信息表格式如下，做市商务必按要求准确报送：

字段	客户名称	组织机构代码	期货公司名称	期货公司编码
说明	做市商的名称	按XXXXXXXX-X格式填写	期货公司的名称	期货公司在监控中心的编码，非会员号
格式	不多于100个字节或者50个汉字	不多于50个字符	不多于100个字节或者50个汉字	不多于8个字符

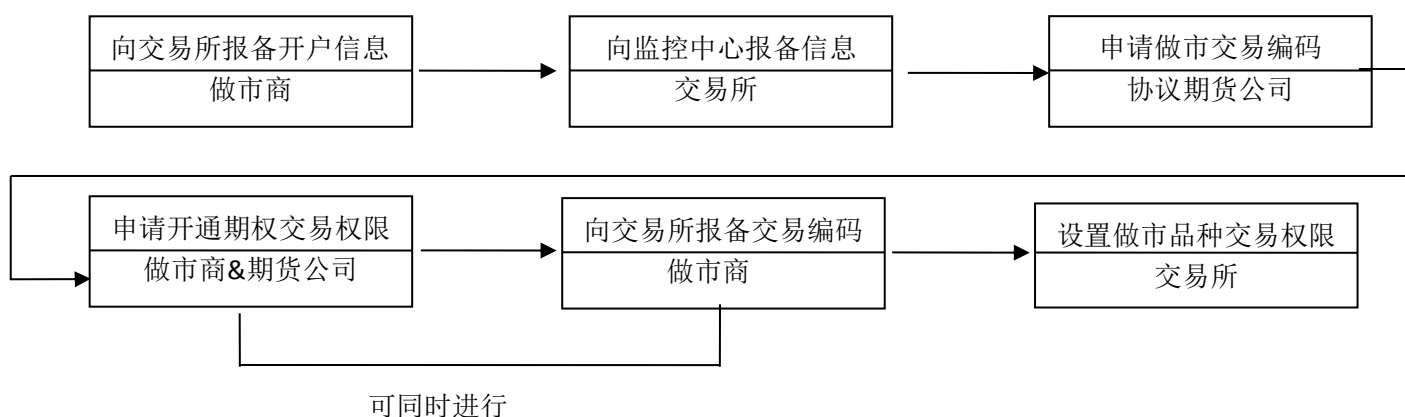
## （二）通过期货公司开户，申请做市交易编码

交易所报备成功且做市商协议签订后，做市商应当委托协议期货公司，通过监控中心统一开户系统申请做市交易编码，期货公司申请交易编码时录入的“客户名称”、“组织机构代码”、“期货公司名称”、“期货公司编码”应当与交易所报备信息完全一致，否则会开户失败。

根据《大连商品交易所期权投资者适当性管理办法》，做市商参与期权交易，期货公司可不对其进行资金、知识测试、仿真交易经历和行权经历的要求，但做市商仍需满足《大连商品交易所期权投资者适当性管理办法》针对一般单位客户的其他要求，并需按照相关要求申请开通做市交易编码期权交易权限。

## （三）做市商向交易所报备做市交易编码

做市交易编码申请成功后，做市商应当向交易所报备做市交易编码（12位）及做市席位号。交易所根据期权品种做市商资格，设置做市期权品种和标的期货品种交易权限。

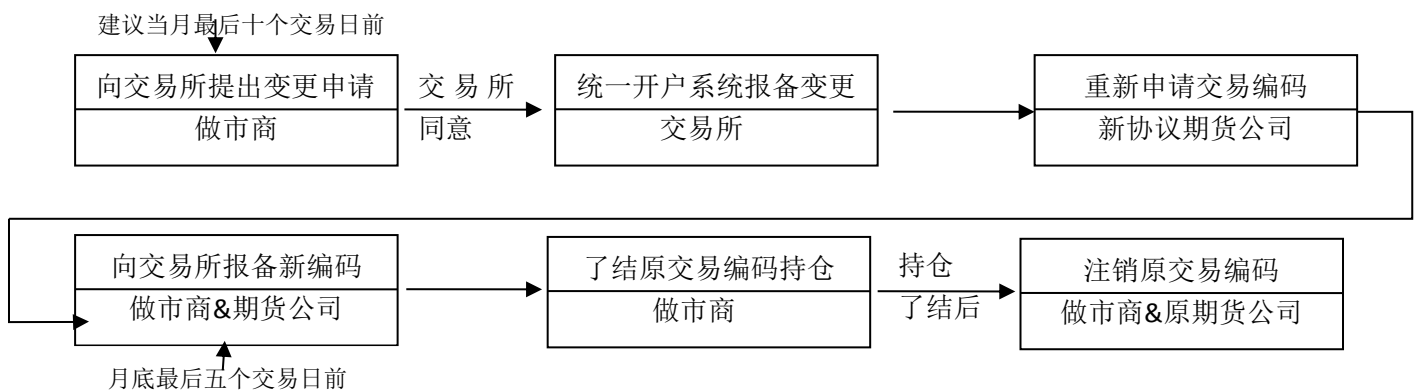


### 三、做市交易编码变更流程

在一个期权品种上,做市商只能使用一个做市交易编码开展做市业务。

做市商需要变更做市交易编码的,应当提前向交易所提交变更申请,并在当月最后五个交易日前报备变更后的做市交易编码,变更后的做市交易编码将在下个月的第一个交易日生效。做市交易编码变更后,做市商应当及时了结变更前做市交易编码下的相关持仓,若该交易编码下无其他做市品种,应在持仓了结后及时注销交易编码。

变更流程为:做市商向交易所提交做市交易编码变更申请(建议在月底倒数十个交易日前申请,申请表见附件4),交易所同意并在统一开户系统报备变更信息后,做市商方可通过新协议期货公司重新申请做市交易编码。新做市交易编码申请成功后,做市商应当在月底倒数五个交易日前向交易所报备,变更后的做市专用交易编码将在下个月的第一个交易日生效。重新申请做市交易编码及报备流程同上。变更做市交易编码流程如下:



#### 四、做市商基本情况变更报备流程

做市商的控股股东（合伙人）、经营场所、法定代表人、做市业务负责人及其联系方式等发生变化，以及财务状况和技术系统等发生重大变化时，应当自发生之日起3个交易日内向交易所报告；做市商协议中载明的邮寄地址、电子邮箱变化的，应当在变化时及时通知交易所，未及时通知的后果由做市商承担。（报备表详见附件5）。

#### 五、提高持仓限额申请流程

因履行做市义务需要，做市商可以在客户投机持仓限额标准基础上，申请增加持仓额度。交易所对做市商持仓豁免的管理包含以下五个方面：

（一）做市商申请持仓豁免时（申请表见附件6），应向监察部提交承诺函（承诺函见附件7）。承诺遵守交易所的各项规则制度，承诺申请持仓额度不用于与做市无关的交易等。《大连商品交易所做市商持仓豁免承诺函》需加盖做市商公章、会员单位公章后原件寄到大连商品交易所监察部。

（二）做市商失去做市商资格后，交易所将限制该交易

编码的开仓权限，要求其在 1 个月内了结原做市交易编码下的相关持仓，并删除其所获得的持仓豁免。

（三）做市商交易编码为做市专用交易编码，不得与其他交易编码共用持仓豁免的额度。

（四）目前仅审核做市商期权持仓豁免，暂不审核期货持仓豁免。

（五）如果市场出现极端情况时，交易所可以视市场情况调整已审核的持仓豁免。

## **六、申请放弃做市商资格流程**

做市商可以申请放弃某期权品种的做市商资格。做市商申请放弃做市商资格的，应当提前一个月向交易所提交申请（申请表见附件 8）。自交易所通知之日起，做市商失去资格，相关做市商协议自动终止。

做市商自放弃或被取消（末位淘汰的除外）某期权品种做市商资格之日起一年内，交易所不再受理其在该期权品种的做市商资格申请。

## **七、做市商异常交易管理要求**

交易所根据《大连商品交易所异常交易管理办法》、《〈大连商品交易所异常交易管理办法（试行）〉有关监管标准及处理程序》、《关于实际控制关系账户投机持仓合并计算相关规则的通知》、《关于〈大连商品交易所异常交易管理办法（试行）〉有关实际控制关系账户监管标准的通知》，对做市商的异常交易行为进行监管。做市商在期权合约上由于做市交易所产生的频繁报撤单行为不作为异常交易行为。

## 八、变更做市交易编码或失去做市商资格相关规定

(一) 做市商变更做市交易编码或者失去某期权品种做市商资格后,应当自变更后的做市交易编码生效或者失去资格之日起1个月内了结原做市交易编码下的相关持仓,出现以下情形的除外:

1. 持仓合约出现同方向连续停板;
2. 持仓合约处于极度虚/实值等情况,合约流动性不足;
3. 交易所认定的其他情形。

自变更后的做市交易编码生效或者失去某期权品种做市商资格之日起,交易所将限制原做市交易编码相关开仓权限。在规定时间未能及时了结持仓且未出现前款三种情形的,交易所将依据《大连商品交易所违规处理办法》采取相关措施。

(二) 原做市交易编码下相关持仓了结后,若做市交易编码下无其他做市品种,做市商应当及时通过做市交易编码所在期货公司注销该交易编码。

同时,监控中心《特殊单位客户统一开户业务操作指引》规定:做市商失去做市资格的,应在15个工作日内注销相关交易编码。

## 第四章 义务和权利

做市商开展做市业务,应当符合《管理办法》以及做市商协议规定的报价要求。交易所对做市商义务完成情况进行



评价。做市商在规定期间内完成做市商协议约定的义务，方可享受权利。

## 一、做市商报价义务

做市商应当在协议有效期内的每个自然月，履行持续报价和回应报价义务。具体要求如下：

### （一）持续报价

做市商应当对主力合约系列的期权合约进行持续报价，持续报价要求如下：

报价类型	持续报价
报价合约	主力合约系列的期权合约
月日均有效持续报价时间比	不小于 60%
最大买卖价差（单位：元/吨）	（1）当 $0 < \text{买入报价} < 50$ ，最大买卖价差= $\text{Max}\{\text{买入报价的 } 12\%, 4\}$ ； （2）当 $50 \leq \text{买入报价} < 400$ ，最大买卖价差= $\text{Max}\{\text{买入报价的 } 7\%, 6\}$ ； （3）当 $400 \leq \text{买入报价}$ ，最大买卖价差= $\text{Max}\{\text{买入报价的 } 6\%, 28\}$ 。
最小报价数量（单位：手）	10

### （二）回应报价

做市商应当对非主力合约系列的期权合约进行回应报价，回应报价要求如下：

报价类型	回应报价
报价合约	非主力合约系列的期权合约
月日均有效回应询价比	不小于 60%
响应时间	不大于 20 秒
持续时间	不小于 10 秒,或者在 10 秒内成交
最大买卖价差（单位：元/吨）	（1）当 $0 < \text{买入报价} < 50$ ，最大买卖价差= $\text{Max}\{\text{买入报价的 } 16\%, 6\}$ ； （2）当 $50 \leq \text{买入报价} < 400$ ，最大买卖价差= $\text{Max}\{\text{买入报价的 } 12\%, 8\}$ ； （3）当 $400 \leq \text{买入报价}$ ，最大买卖价差= $\text{Max}\{\text{买入报价的 } 10\%, 48\}$ 。
最小报价数量（单位：手）	10

### （三）指标解释

1.主力合约系列是指其标的期货合约在近五个交易日内的总成交量在该品种所有期货合约成交量中排名前三名（若第三名并列，取近月期货合约）的所有期权合约，以交易所发布为准。

2.非主力合约系列是指某期权品种除主力合约系列以外的所有期权合约。

3.主力合约系列和非主力合约系列在每个交易日闭市后进行更新。

4.最优报价数量是指做市商报入的最优买入价和最优卖出价的成对委托报价数量。

5.最优买卖价差是指做市商在同一时刻最优卖出价与最优买入价之差。

6.响应时间是指交易所系统收到询价与做市商回应报价之间的时间差。

7.持续时间是指做市商在响应时间内回应报价的挂单，与撤单或成交的时间差的累计值。响应时间内可以修改价格，持续时间累计计算。

8.每交易日的有效持续报价时间比，是指在履行持续报价义务的所有合约上，做市商报价处于有效持续报价状态的时间总和与交易时间总和的比例。

9.每交易日的有效回应询价比，是指在履行回应报价义务的所有合约上，做市商有效回应报价次数总和与询价请求

次数总和的比例。

（四）交易所根据市场情况，要求做市商对指定期权合约进行报价。

## 二、做市商报价义务免除情形

市场出现下列情形之一的，交易所免除做市商相应的报价义务：

（一）期权合约开盘集合竞价期间，免除做市商在所有做市合约上的报价义务；

（二）标的期货合约达到涨跌停板价格时，免除做市商在该月份的所有期权合约上的报价义务；

（三）期权合约达到涨跌停板价格时，免除做市商在该期权合约上的报价义务；

（四）期权合约存在符合协议要求的报价价差和报价数量的委托时，交易所系统不接受询价请求，相应免除做市商在该期权合约上的回应报价义务；

（五）做市商在某期权合约上的卖出报价小于或等于2元/吨时，免除该做市商在该期权合约上的买入报价义务；

（六）交易所认定的其他情形。

对于交易所系统已经接受的询价请求，不因其他做市商回应报价或者市场出现符合协议规定的报价价差和报价数量的委托，而免除回应报价义务。

做市商义务免除仅限于前述规定的情形发生时，前述规定情形消失后，做市商应当继续履行相应的做市义务。

### 三、做市商权利

根据做市商义务完成情况，做市商可以享有交易手续费减收等权利。交易手续费减收的具体标准通过做市商协议确定。

### 四、做市商排名和末位淘汰

交易所可以对做市商做市义务完成情况进行评价，并进行年度排名，或者根据需要进行排名。评价内容包括有效持续报价时间比、有效回应询价比、成交及买卖价差等情况。

在豆粕期权品种年度做市评价排名中处于最末位（含并列情况），且年度日均有效持续报价时间比或年度日均有效回应询价比小于 80% 的做市商，将被末位淘汰。被末位淘汰的做市商可以再次申请做市商资格。

## 第五章 技术系统

做市商开展期权做市业务，应当具有稳定、可靠的技术系统。交易所可以对做市商做市系统进行评估、检查或者要求进行测试等。

### 一、技术系统基本要求

做市商技术系统应具备安全性、稳定性。做市业务系统应当与其他业务系统进行隔离。做市系统应当包括但不限于行情显示、权限管理、定价与做市策略、交易管理、风险控制、资金管理、行权管理、持仓管理、做市义务统计以及批量撤单、一键撤单等基本功能。做市业务相关人员应当熟练

掌握系统功能和各项操作。

做市商应当建立健全信息技术管理制度、信息系统报备制度及应急机制，按季度向交易所报告做市技术系统开发、测试、接入和升级等变化情况。技术系统发生重大变化时，须在发生之日起3个交易日内向交易所提交书面报告，并须按照交易所要求参与相关测试及应急演练工作。

做市商应当定期对技术系统性能、容量以及是否支持本所做市业务规则进行评估和测试，确保系统满足做市业务需要。

做市商应当保障做市系统安全、稳定、可靠，并根据相关要求配置硬件配置，建立备份系统。

## 二、技术系统风险管理

做市商应当设立做市业务风险监控系統，并进行风险指标监控。做市商应针对期权业务每日实施独立监控，包括但不限于风险指标、持仓、资金、极端情况、强平处理等风险指标监控和预警。

做市商系统需要设置严格的分权限管理，建立健全岗位分离和监督制约机制。

做市商应当对做市业务开展压力测试，对做市系统进行全面检查，并度量极端不利市场环境下可能遭受的潜在损失风险。

做市商应当明确技术系统应急处置机制和流程，确保在相应情形发生时立即进行应急处置。在做市系统发生紧急情况时启用做市系统的一键撤单功能，确保不对市场产生相关

影响。

### 三、信息技术制度

做市商应当建立健全信息技术管理制度、信息系统报备制度。信息技术管理制度包含但不限于做市业务技术系统建设目标、设计原则、系统架构图、各功能模块配置、功能说明、系统建设流程、相关管理制度等内容以及相关文档清单。信息系统报备制度包括但不限于信息技术系统开发、测试、接入和升级等变化情况的报备制度。做市系统在建设过程中应经过严格的评审和测试流程，在实施过程中应当制定详细的项目计划，充分考虑实施过程中的风险点及应急措施，并对系统上线后的日常运营管理、容灾备份策略及应急处理措施进行规范。

做市商应当建立完善的做市系统运行监控机制，对做市系统的运行环境、运行状况进行实时监控并报警。对报警记录进行及时处理，并留存相关记录。定期对做市系统进行检查，对检查情况进行分析、评审，发现问题要及时采取必要的应对措施。做市系统应当具备业务操作日志保存功能，并可供核查。

## 第六章 监督管理

本所按照《管理办法》及相关业务规则对做市商进行监管，做市商及协议期货公司应当配合交易所进行监管。

## **一、业务隔离**

做市业务应当以为市场提供流动性为主要目的，做市业务应当与公司其他业务进行有效隔离。做市商应当建立完善的风险防范与业务隔离制度，有效防范做市业务与公司其他业务之间的利益冲突，不得利用做市业务谋取不正当利益。

做市商应当使用专门的做市交易编码开展做市业务，做市交易编码只能用于履行做市义务及进行相关交易，不得用于其他无关交易。做市业务资金、团队人员、技术系统、办公场所等应当与公司其他业务进行分开管理，有效隔离。

## **二、日常监管**

做市商应当具备稳定的技术系统、健全的风险管理和内部控制制度、有效的风险防范体系，确保做市业务风险可控。

做市商应当按照交易所要求报告做市业务情况，进行数据报送，妥善保存相关交易及风控记录，以备核查。

交易所可以对做市商的风险管理、交易行为、系统运行以及经营、资信等情况进行监督和检查，做市商应当予以协助和配合。

做市商应当持续满足《管理办法》要求的资格条件。

## **三、违规处理**

做市商违反相关规定的，交易所按《大连商品交易所违规处理办法》、《大连商品交易所期权做市商管理办法》的有关规定处理。

- 附件：
1. 大连商品交易所期权做市商资格申请表
  2. 期权做市商岗位设置与人员情况汇总表
  3. 承诺书
  4. 大连商品交易所期权做市商变更做市交易编码申请表
  5. 大连商品交易所期权做市商基本情况变更报备表
  6. 大连商品交易所增加期权持仓额度申请表
  7. 大连商品交易所期权做市商持仓豁免承诺函
  8. 大连商品交易所期权做市商放弃做市商资格申请表



附件 1

## 大连商品交易所期权做市商资格申请表

申请单位名称		申请做市期权品种	
法定代表人姓名		组织机构代码	
做市业务负责人姓名		做市业务负责人 联系电话	
做市业务拟接入 期货公司名称		期货公司联系人 及联系电话	
做市技术系统名称		做市系统开发商	
参与本所豆粕期权仿 真交易做市交易编码 及做市情况简要说明			
本所豆粕期权做市业 务负责人及主要相关 人员是否在中国境内 从事做市业务	是 否	是否以发售基金、理 财、信托、资管产品 等方式募集资金开 展做市业务	是 否
<p>声明：本单位对所提供材料的真实性、准确性和完整性负责，并自愿承担因材料不实导致的一切后果。</p>			
<p>申请单位法定代表人签章</p>		<p>申请单位公章 年 月 日</p>	
<p>声明：本公司同意该申请单位通过本公司开展做市业务，对做市业务风险有充分的认识，并且采取了相应的风险防控措施。</p>			
<p>期货公司法定代表人签章</p>		<p>期货公司公章 年 月 日</p>	

## 附件 2

# 期权做市商岗位设置与人员情况汇总表

注：做市业务负责人、交易岗、风控岗、技术岗主要人员必须另附详细个人简历。

申请单位名称			填表时间	
做市业务 负责人	姓名			
	部门			
	电话		邮箱	
做市业务 联络人	姓名			
	部门			
	电话		邮箱	
<b>岗位设置与人员情况</b>				
(岗位 1) 工作职责： (1) (2)				
姓名	工作履历		做市相关经验	
	(起止年月-单位-职责描述)			
(岗位 2) 工作职责： (1) (2)				
姓名	工作履历		做市相关经验	
	(起止年月-单位-职责描述)			
(岗位 3) 工作职责： (1) (2)				
姓名	工作履历		做市相关经验	
	(起止年月-单位-职责描述)			

## 附件 3

# 承诺书

大连商品交易所：

根据《大连商品交易所期权做市商管理办法》，本公司承诺最近三年无重大违法违规行为，未因违法违规行为受到行政处罚或者刑事处罚，如上述承诺与实际不符，本公司愿承担由此产生的一切不利后果，包括但不限于取消做市商资格。

公司名称（加盖公章）：

日期：

## 附件 4

## 大连商品交易所期权做市商变更做市交易 编码申请表

申请单位名称		组织机构代码	
做市品种		原做市交易编码(12位)	
原做市交易编码 所在期货公司		变更后期货公司名称及 在监控中心的编码	
做市业务 负责人姓名		做市业务负责人 联系电话	
变更后期货公司 联系人姓名		变更后期货公司 联系人电话	
变更做市 交易编码的原因			
申请单位法定代表人签章		申请单位公章 年 月 日	
声明：本公司同意该申请单位通过本公司开展做市业务，对做市业务风险有充分的认识，并且采取了相应的风险防控措施。			
法定代表人签章 （变更后拟接入的期货公司）		期货公司公章 年 月 日	

附件 5

## 大连商品交易所期权做市商基本情况 变更报备表

申请单位名称		组织机构代码	
做市品种		做市交易编码（12位）	
变更事项及原因			
变更前			
变更后			
做市业务 负责人姓名		做市业务 负责人联系电话	
法定代表人签章		申请单位公章 年    月    日	

注：

1. 做市商的控股股东（合伙人）、经营场所、法定代表人、做市业务负责人及其联系方式等发生变化，以及财务状况和技术系统等发生重大变化时，应当自发生之日起3个交易日内向交易所报。
2. 做市商协议中载明的邮寄地址、电子邮箱变化的，应当在变化时及时通知交易所。

附件 6

## 大连商品交易所增加期权持仓额度申请表

填写日期：

一、申请人基本情况							
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	
二、增加期权持仓额度客户类型							
客户类型	<input type="checkbox"/> 期权标的期货套期保值客户 <input type="checkbox"/> 期权或期货期权套利客户 <input type="checkbox"/> 期权做市商						
期权品种适用	申请品种	申请前持仓额度			申请持仓额度		
备注	客户盖章处加盖客户公章，会员盖章处加盖会员公章或授权章。审核额度见交易所会员服务系统通知。						

客户盖章：

会员盖章：

附件 7

## 大连商品交易所期权做市商持仓豁免 承诺函

大连商品交易所：

我司因履行做市义务需要，申请在客户期权投机持仓限额标准基础上，增加期权持仓额度。

我司已知悉并同意交易所可以根据市场情况调整或取消已审核的持仓额度。我司承诺遵守交易所的各项规则制度，不会利用所申请的持仓额度从事与做市业务无关的其他交易，并将根据交易所监管要求，及时、主动、有序地将持仓降到客户投机持仓限额内。同时，我司承诺将根据交易所要求，提供持仓额度使用、做市交易和风险管理等与做市业务相关的情况说明、资产证明以及其他材料。

客户盖章：

会员盖章：

年 月 日

## 附件 8

## 大连商品交易所期权做市商放弃做市商 资格申请表

申请单位名称		组织机构代码	
法定代表人姓名		取得做市商资格时间	
做市品种		做市交易编码（12 位）	
做市业务 负责人姓名		做市业务 负责人联系电话	
做市业务 联系人姓名		做市业务 联系人电话	
申请放弃做市商 资格的原因			
法定代表人签章		单位公章 年 月 日	

注：做市商放弃期权品种做市商资格，应当提前一个月向交易所提出申请。