

广州期货交易所 做市业务指南

广州期货交易所

2022年12月

目 录

说明	3
做市业务指南	4
一、做市商资格申请	4
二、做市商协议签署	6
三、做市交易编码申请及报备	6
(一) 做市商信息报送	6
(二) 通过协议会员开户, 申请做市交易编码	7
(三) 做市商向交易所报备做市交易编码和做市使用席位	7
四、做市交易编码变更	7
五、做市商基本情况变更报备	8
六、做市商手续费减收	8
七、申请放弃做市商资格	9
广州期货交易所做市商资格申请表	10
广州期货交易所做市商岗位设置与人员情况汇总表	11
承诺书	12
广州期货交易所做市商做市交易编码、使用席位报备表	13
广州期货交易所做市商变更做市交易编码申请表	14
广州期货交易所做市商基本情况变更报备表	15
广州期货交易所做市商放弃资格申请表	16

说明

为便于广州期货交易所（以下简称交易所、本所）各期货、期权品种做市商开展做市交易，根据《广州期货交易所做市商管理办法》及相关规定，制定本指南。本指南仅供做市商开展做市交易时参考，如有内容与本所业务规则不一致，以本所业务规则为准。本所将根据业务规则变化，对本指南进行更新。

本所联系方式：

电话：020-28183991

邮箱：mmservice@gfex.com.cn

地址：广州市天河区临江大道1号，寺右万科中心南塔12层

做市商资格申请（指南第一部分）、做市交易编码申请及报备（指南第三部分）相关的电子版材料发送至以上邮箱，做市商席位通过会服系统进行报备。纸质版材料均寄送至以上地址。

做市业务指南

一、做市商资格申请

交易所根据相关工作安排，启动某一期货、期权品种做市商招募流程，具体审核形式以交易所相关要求为准。

申请人应当在交易所规定的时间内提交申请材料。如无特别指出，申请人应当将加盖单位公章的全部申请材料的电子版及纸质版提交至交易所。

申请材料包括：

（一）经法定代表人或者有权签署人签署并加盖单位公章（如有）的做市商资格申请表（附件 1：《广州期货交易所做市商资格申请表》）；

（二）加盖单位公章的营业执照复印件，或者经公证和依法认证的申请人合法成立的资料；

（三）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（**加盖首页和骑缝**）的最近一期财务会计报告复印件，或者经会计师事务所或审计师事务所有权签署人签署的最近一期财务会计报告复印件；

（四）做市部门的岗位设置和职责规定，以及做市负责人及相关人员的名单、履历（附件 2：《广州期货交易所做市商岗位设置与人员情况汇总表》）；

（五）做市实施方案、内部控制制度和风险管理制度；

1.做市交易实施方案应包括但不限于：做市交易总体设想（投入做市交易的资金规模、投入人员及详细情况等）；做市策略（定价模型、不同情况下的报价策略、对冲策略、存货管理策略等）；做市系统基本功能（做市策略交易、合

约管理、订单管理、报价参数管理、报价模型管理、批量撤单、前端控制等); 做市报价价差与参与率管理 (报价价差、报价数量、双边持续报价情况等)。

2.内部控制制度应包括但不限于: 业务运行管理 (做市交易运行管理各要素等); 合规与内部控制 (授权管理机制、投资决策流程、业务隔离机制等); 责任人及其职责管理 (做市交易相关部门、岗位人员及其职责管理等)。

3.风险管理制度应包括但不限于: 风险控制制度 (公司或部门层面做市交易风险控制制度等); 市场风险管理 (Greeks、市场大幅波动、隔夜风险等的管理); 保证金管理 (保证金监控、强行平仓管理等); 交割风险管理 (临近到期头寸管理、交割违约风险管理等); 操作风险管理 (持仓、交易和风险敞口的限额, 合理性检查, 前端控制, 授权, 可投资标的等); 流动性风险管理 (流动性风险的应对方式等); 预警制度 (突发事件的情形、分类; 预警机制、响应机制及流程; 各类应急处理方式及流程等)。

(六)最近三年无重大违法违规记录的承诺书 (附件 3:《承诺书》);

(七)做市技术系统情况的说明;

说明内容应包括但不限于: 系统架构、业务功能模块、风控模块、物理部署、开发升级流程 (包括开发、测试和上线等关键环节)、应急处理机制等。自主开发系统的, 还须提供开发团队和核心开发人员情况; 购买或与软件开发商合作开发系统的, 还须提供开发商的基本材料 (包括公司背景、注册资金、主要产品、开发实施资质、开发团队等基本情况)。

(八)相关交易、做市或者仿真交易做市情况的说明;

说明内容应包括但不限于：拟做市品种或相关品种交易情况；仿真交易做市期间义务履行、交易系统运行以及盈利等；交易所认可的做市期间义务履行、交易系统运行以及盈利等。

（九）交易所要求提供的其他材料。

其他材料包括但不限于：**公司股东、成立时间、注册地址、办公地址、净资产、净资本**等基本情况的说明；期货公司风险管理子公司还须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。

二、做市商协议签署

经交易所批准后，申请人应当自收到交易所通知之日起10个交易日内，与交易所签订做市商协议。逾期未签订协议的，自动放弃申请做市商资格。

在与交易所签订做市商协议前，做市商应当先与做市交易所在本所会员（以下简称协议会员，建议做市商通过同一会员开展各期货、期权品种做市交易）就做市有关事项达成一致意见，并将加盖会员公章的达成一致意见的承诺书与做市商协议提交至交易所。

三、做市交易编码申请及报备

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。做市商须申请一个专用的做市交易编码（做市交易编码为会员号（4位）+做市专用客户号（8位）），用于履行做市义务及进行相关交易。

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”、“会员名称”、“会员编码或会员号”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	会员名称	会员编码或会员号
说明	做市商的名称	按XXXXXXXX-X格式填写	会员的名称	会员在监控中心的编码或者在交易所的会员号，请注明类型
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）通过协议会员开户，申请做市交易编码

接到交易所报备成功通知且与交易所签订做市商协议后，做市商应当委托协议会员，通过监控中心统一开户系统申请做市交易编码，协议会员申请交易编码时录入的“客户名称”、“组织机构代码”、“会员名称”、“会员编码或会员号”应当与交易所报备信息完全一致，否则会开户失败。

（三）做市商向交易所报备做市交易编码和做市使用席位

做市交易编码申请成功后，以电子版形式向交易所报备做市交易编码及做市使用席位号（附件4：《广州期货交易所做市商做市交易编码、使用席位报备表》）。交易所根据期货、期权品种做市商资格，设置做市品种和标的/同标的期货品种交易权限。

四、做市交易编码变更

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，交易所同意后，方可向新协议会员申请新的做市交易编码。

变更流程为：做市商向交易所提交做市交易编码变更申请（建议在当月倒数第十个交易日前申请，附件 5：《广州期货交易所做市商变更做市交易编码申请表》）及其与新协议会员达成一致意见的承诺书，交易所同意并向监控中心变更备案信息后，做市商方可通过新协议会员重新申请做市交易编码。

新做市交易编码申请成功后，做市商以电子版形式将其新做市交易编码及做市使用席位号向交易所报备（附件 4：《广州期货交易所做市商做市交易编码、使用席位报备表》），变更后的做市交易编码在下个月第一个交易日生效。

如果原做市交易编码下无其他做市品种，做市商应当在 30 个工作日内注销原做市交易编码。

五、做市商基本情况变更报备

做市商的控股股东（合伙人）、经营场所、法定代表人、做市交易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书面报告；做市资金规模、做市商协议中载明的地址、邮编、电子邮箱发生变化时，应及时通知交易所（附件 6：《广州期货交易所做市商基本情况变更报备表》）。

六、做市商手续费减收

交易所原则上在每个自然月的第五个交易日前，根据做市商协议相关规定，计算做市商上一个月手续费减收额度，

并从该做市商所在协议会员每个交易日应交纳的相关品种手续费中抵减，直至抵减完成。协议会员对做市商做市品种交易手续费减收的具体方式，由协议会员与做市商自行约定。

若义务考核周期内，交易所调整期权、期货手续费政策，交易所所有权根据手续费调整情况对做市商的当月应减收额度进行调整。

若做市商变更做市交易编码，对于其变更前手续费减收额度，交易所向该做市商做市交易编码变更前的所在协议会员抵减。

七、申请放弃做市商资格

做市商可以申请放弃其某品种的做市商资格。做市商申请放弃某品种做市商资格的，应当提前一个月向交易所提交书面申请（附件 7：《广州期货交易所做市商放弃资格申请表》）。

做市商申请放弃或被取消某品种做市商资格的，自交易所通知失去资格之日起，其与交易所签订的相关协议自动终止，一年内交易所不再受理其该品种的做市商资格申请。

附件 1

广州期货交易所做市商资格申请表

申请单位名称			
申请做市品种		申请做市商类别	
法定代表人姓名		组织机构代码	
做市交易负责人姓名		做市交易负责人 联系电话(手机)及 邮件地址	
做市交易联系人姓名		做市交易联系人 联系电话(手机)及 邮件地址	
做市交易拟接入 会员名称		会员联系人及联系 电话(手机)	
做市技术系统名称		做市系统开发商	
做市交易负责人及主 要相关人员是否在中 国境内从事做市交易	是 否	是否以自有资金开 展做市交易	是 否
<p>本单位承诺遵守交易所各项规定,所提供材料真实、准确、完整,不存在虚假记载、误导性陈述和重大遗漏。提交材料如下:</p> <p>特此声明。</p> <p>申请单位法定代表人签章 申请单位公章 年 月 日</p>			
<p>本公司同意该申请单位通过本公司开展做市交易,对做市交易风险有充分的认识,并且采取了相应的风险防控措施;本公司就该单位做市交易系统接入柜台系统已进行充分测试;与该单位就减收手续费等事项已达成一致,对该单位申请广州期货交易所做市商资格无异议。</p> <p>会员法定代表人签章 会员公章 年 月 日</p>			

附件 2

广州期货交易所做市商岗位设置与人员情况汇总表

申请单位名称			
做市交易 负责人	姓名		
	部门		
	电话		邮箱
做市交易 联系人	姓名		
	部门		
	电话		邮箱
岗位设置与人员情况			
(岗位 1) 工作职责： (1) (2)			
姓名	工作履历	做市相关经验	
	<i>(起止年月-单位-职责描述)</i>		
(岗位 2) 工作职责： (1) (2)			
姓名	工作履历	做市相关经验	
	<i>(起止年月-单位-职责描述)</i>		
(岗位 3) 工作职责： (1) (2)			
姓名	工作履历	做市相关经验	
	<i>(起止年月-单位-职责描述)</i>		

注：做市交易负责人、交易岗、风控岗、技术岗主要人员必须另附详细个人简历。

附件 3

承诺书

广州期货交易所：

根据《广州期货交易所做市商管理办法》及相关规定，
本公司承诺最近三年无重大违法违规行为，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

广州期货交易所做市商做市交易编码、使用席位报备表

单位名称		组织机构代码	
做市品种		做市交易编码 (8位)	
做市使用席位			
联系人		联系电话	
联系邮箱			
所在会员名称		会员号	
会员联系人		会员联系电话	
会员联系邮箱			
<p>根据《广州期货交易所做市商管理办法》及相关规定，本公司通过所在会员申请做市交易编码用于做市交易。</p>			
<p>法定代表人签章</p>		<p>单位公章</p>	
<p>年 月 日</p>			
<p>本公司同意该申请单位通过本公司开展做市交易，对做市交易风险有充分的认识，并且采取了相应的风险防控措施。本公司就该单位做市交易系统接入柜台系统已进行充分测试，与该单位就减收手续费等事项已达成一致。</p>			
<p>会员法定代表人签章</p>		<p>会员公章</p>	
<p>年 月 日</p>			

附件 5

广州期货交易所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 所在会员名称		变更交易编码后 所在会员名称	
做市交易 负责人姓名		做市交易 负责人联系电话	
做市交易 联系人姓名		做市交易 联系人电话	
变更做市 交易编码的原因			
变更后拟接入会员 联系人		变更后拟接入会员 联系人电话	
申请单位法定代表人签章		申请单位公章	
		年 月 日	
<p>本公司同意该申请单位通过本公司开展做市交易，对做市交易风险有充分的认识，并且采取了相应的风险防控措施。本公司就该单位做市交易系统接入柜台系统已进行充分测试，与该单位就减收手续费等事项已达成一致。</p>			
法定代表人签章 (变更后拟接入的会员)		会员公章	
		年 月 日	

附件 6

广州期货交易所做市商基本情况变更报备 表

单位名称		组织机构代码	
做市品种		做市交易编码	
变更事项及原因			
变更前			
变更后			
业务联系人		联系电话	
<div style="display: flex; justify-content: space-between; align-items: flex-end;"> <div style="text-align: center;"> <p>法定代表人签章</p> </div> <div style="text-align: center;"> <p>单位公章</p> <p>年 月 日</p> </div> </div>			

注：

1. 做市商的控股股东（合伙人）、经营场所、法定代表人、做市交易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书面报告。
2. 做市资金规模，做市商协议中载明的地址、邮编、电子邮箱发生变化的，应当在变化后及时通知交易所。

附件 7

广州期货交易所做市商放弃资格申请表

申请机构名称		组织机构代码	
申请放弃做市品种		做市交易编码/ 使用席位号	
做市交易 负责人姓名		做市交易 负责人联系电话	
做市交易 联系人姓名		做市交易 联系人电话	
申请放弃做市商 资格的原因			
<p>法定代表人签章</p> <p style="text-align: right;">单位公章 年 月 日</p>			

注：做市商申请放弃某品种做市商资格的，应当至少提前一个月向交易所提交书面申请。