

郑州商品交易所 期权做市业务操作流程

郑州商品交易所

2017年3月

目 录

说明.....	3
期权做市商业操作流程.....	4
一、做市商协议签署流程.....	4
二、做市交易编码申请及报备流程.....	4
三、做市交易编码变更流程.....	5
四、专用席位、备用席位报备及启用流程.....	6
五、做市商基本情况变更报备流程.....	6
六、做市商手续费减收流程.....	7
七、增加持仓限额申请流程.....	7
八、申请放弃做市商资格流程.....	8
九、报价义务免除申请流程.....	8
郑州商品交易所期权做市商专用交易编码、席位报备表.....	9
郑州商品交易所期权做市商变更做市交易编码申请表.....	10
郑州商品交易所期权做市商备用席位启用报备表.....	11
郑州商品交易所期权做市商基本情况变更报备表.....	12
郑州商品交易所做市商增加期权持仓额度申请表.....	13
郑州商品交易所期权做市商放弃做市商资格申请表.....	14
郑州商品交易所期权做市商报价义务免除申请表.....	15

说明

为便于做市商开展做市业务，根据《郑州商品交易所做市商管理办法》和《郑州商品交易所期权做市商协议书》，对做市业务流程进行了梳理。做市业务流程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。

联系人及联系方式：

交易部：吕彤，0371- 65612893

传真：0371-65613278

邮箱：lvtong@czce.com.cn

地址：郑州市郑东新区商务外环路 30 号期货大厦

期权做市商业操作流程

一、做市商协议签署流程

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, 做市业务只允许在一家期货公司开户) 签订协议, 就做市有关事项达成一致意见, 并将其与做市商协议一同提交至交易所。

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”、“期货公司名称”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
说明	做市商的名称	按 XXXXXXXX-X 格式	期货公司的名称

		填写	
格式	不多于 20 个汉字	不多于 10 个字符	不多 20 个汉字

（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。

根据《郑州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《郑州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和做市席位

做市交易编码申请成功后，以电子版和书面材料形式向交易所报备做市交易编码及做市席位号。（附件 1：《郑州商品交易所期权做市商专用交易编码、席位报备表》）

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，交易所同意后，做市商需将原交易编码下持仓了结并注销后，方可向新协议期货公司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（附件 2：《郑州商品交易所期权做市商变更做市交易编码申请表》）及其与新协议公司签订的协议，交易所同意后，做市商需将原交易编码下持仓了结并注销，之后交易所向监控中心变更备案信息，最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，以电子版和书面材料方式将其新专用交易编码和席位号向交易所报备，变更后的做市专用交易编码生效日期以交易所通知为准。

四、专用席位、备用席位报备及启用流程

做市商可以按相关要求报备专用席位和备用席位。专用席位和备用席位报备表见附件 1。专用席位和备用席位均需向交易所交易部报备，专用席位只能用于做市使用，备用席位日常不允许做市使用，由于应急需要需启用备用席位时，应在启用当天向交易所交易部报备启用原因，报备表见附件 3 《郑州商品交易所期权做市商备用席位启用报备表》。

五、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书面报告；做市商协议中载明的地址、联系人和电话发生变化时，应及时通知交易所（附件 4：《郑州商品交易所期权做市商基本情况变更报备表》）。

六、做市商手续费减收流程

交易所在每月最后一个交易日，根据做市商协议书相关规定，计算做市商当月交易手续费应减收额度，于次月第 1 个交易日开始从该做市商所在协议期货公司每个交易日应缴纳的期权和期货交易手续费中抵减，未减完部分不向下月积累。协议期货公司对做市商期权交易手续费减收的具体方式，由协议期货公司与做市商自行约定，妥善处理好相关事宜。交易所将做市商手续费减收额度减收到协议期货公司，视为完成减收义务，减收义务完成后，交易所不再承担任何法律责任。

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所在协议期货公司抵减。

七、增加持仓限额申请流程

因履行做市义务需要，做市商可以在原持仓额度的基础上申请增加持仓额度。初期做市商持仓额度管理如下：

（一）根据做市义务需要，可以向交易所提交《郑州商品交易所做市商增加期权持仓额度申请表》（附件 5），交易所根据其持仓额度使用情况进行审核；

(二) 目前仅审核做市商增加期权持仓额度申请，暂不审核增加期货持仓额度申请。

(三) 交易所可以视市场情况调整已审核的持仓额度。

八、申请放弃做市商资格流程

做市商可以申请放弃其某期权品种的做市商资格。做市商申请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交书面申请（附件 6：《郑州商品交易所期权做市商放弃做市商资格申请表》）。

做市商放弃或被取消某期权品种做市商资格的，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在该期权品种的做市商资格申请。

九、报价义务免除申请流程

根据《郑州商品交易所做市商管理办法》和《郑州商品交易所期权做市商协议书》，做市商可以在规定情形下向交易所提出报价义务免除申请，并应于当月最后一个交易日前将申请表提交至交易所（附件 7：《郑州商品交易所期权做市商报价义务免除申请表》）。

附件 1

郑州商品交易所期权做市商专用交易编码、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	
所在期货公司名称		会员号	
联系人		电话	
邮箱			
原专用席位		新增专用席位	
原备用席位		新增备用席位	
取消席位			
<p>根据《郑州商品交易所做市商管理办法》和《郑州商品交易所期权做市商协议书》，本公司通过所在期货公司会员申请专用的做市交易编码和席位用于做市业务，并承诺不通过做市交易编码和席位开展其他交易。</p>			
<p>法定代表人签章</p>		<p>单位公章</p> <p>年 月 日</p>	
<p>会员公司公章</p> <p>年 月 日</p>			

注：该表电子版及原件均需提交至交易所。

附件 2

郑州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	
原做市交易编码 所在期货公司名称		变更交易编码后 所在期货公司名称	
做市业务 负责人姓名		做市业务 负责人联系电话	
做市业务 联络人姓名		做市业务 联络人联系电话	
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	
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 3

郑州商品交易所期权做市商备用席位启用报备表

单位名称		做市交易编码	
所在期货公司名称		会员号	
联系人		电话	
做市品种			
邮箱			
备用席位			
启用时间		结束时间	
启用说明：			
做市负责人签章：			
年 月 日			

注：该表需发送电子版和传真。

附件 4

郑州商品交易所期权做市商基本情况变更报备表

单位名称		组织机构代码	
所在期货公司名称		会员号	
做市品种		做市交易编码	
变更事项及原因			
变更前			
变更后			
业务联络人		联系电话	
法定代表人签章 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书面报告。
2. 做市商协议中载明的邮寄地址、联系人及电话变化的，应当在变化时及时通知交易所。

附件 5

郑州商品交易所做市商增加期权持仓额度申请表

一、申请人基本情况							
单位名称		做市交易编码		联系人		电话	
期货公司名称		会员号		联系人		电话	
二、持仓使用说明（包括持仓额度使用、做市交易和风险管理等与做市业务相关的情况）							
三、增加期权持仓额度							
申请品种	申请前持仓额度		申请后持仓额度				
<p>因履行做市义务需要，本公司申请增加期权持仓额度。本公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。本公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，并承诺提供交易所要求的其他材料。</p>							
法定代表人签章				申请单位公章 年 月 日			
期货公司公章 年 月 日							

注：审核额度及其生效日期以交易所通知为准。该表电子版及原件均需提交至交易所。

附件 6

郑州商品交易所期权做市商放弃做市商资格申请表

申请机构名称		组织机构代码	
所在期货公司名称		会员号	
做市品种		做市交易编码/专用席位号	
做市业务负责人姓名		做市业务负责人联系电话	
做市业务联络人姓名		做市业务联络人联系电话	
申请放弃做市商资格的原因			
法定代表人签章	<div style="text-align: right;"> 单位公章 年 月 日 </div>		

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

附件 7

郑州商品交易所期权做市商报价义务免除申请表

单位名称		做市交易编码	
期货公司名称		会员号	
联系人	姓名	电话	
	邮箱		
申请免除报价义务期权合约			
合约月份	免除日期	免除原因	
<p>本公司依据《郑州商品交易所做市商管理办法》及《郑州商品交易所期权做市商协议书》，申请免除相关情形下的报价义务。</p> <p style="text-align: right;">做市商业务负责人签字：</p> <p style="text-align: right;">（公章）</p> <p style="text-align: right;">年 月 日</p>			