

关于举办甲醇期货做市商选拔赛的通知

郑商函〔2019〕111号

期货公司子公司、证券公司、产业客户及其他相关单位：

为促进甲醇期货连续活跃，提高甲醇期货服务实体经济的能力，郑州商品交易所（以下简称郑商所）将举办甲醇期货做市商选拔比赛，从中选拔具有优秀做市能力的做市商。现将有关事项通知如下：

一、甲醇期货做市商选拔赛规则

（一）比赛时间

2019年5月2日至7月31日。

（二）报价要求

使用双边报价指令为MA911合约提供报价，双边报价最大买卖价差不得超过该合约最小变动价位的5倍（5元/吨），最小挂单量不得低于10手，每个自然月在该合约的有效持续报价时间比例不低于60%。其中，有效报价持续时间计算方法为：

1. 有效持续报价未成交或成交后双边挂单量仍不低于10手的，其持续报价时间为撤单时间（未撤单时按闭市时间）与报单时间的差；

2. 有效持续报价成交后至少有一边挂单量小于10手的，其持续时间为成交后单边最早小于10手的成交时间与报单

时间的差。

（三）频繁报撤豁免

根据《郑州商品交易所异常交易行为管理办法》规定，比赛期间参赛单位由 MA911 合约做市交易产生的频繁报撤单行为不构成异常交易行为。

（四）交易手续费

申请单位有效持续报价时间比例符合要求的，每月在 MA911 合约上正常交易（非自成交、定单手数不超过 20 手等）发生的交易手续费，郑商所将于次月第一个交易日开始，从其所在期货公司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。

二、申请条件

符合以下条件的相关单位均可申请参加甲醇期货做市商实盘选拔赛：

1. 净资产不低于人民币 5000 万元；
2. 具有专门机构和人员负责做市交易，做市人员熟悉相关法律法规和交易所业务规则；
3. 具有健全的做市交易实施方案、内部控制制度和风险管理制度；
4. 最近三年无重大违法违规记录；
5. 具备稳定、可靠的做市交易技术系统；
6. 具有交易所认可的交易、做市或者仿真交易做市的经

历；

7. 交易所规定的其他条件。

三、申请材料

1. 经法定代表人签章并加盖单位公章的甲醇期货做市商选拔赛申请表（附件 1）及做市商资格申请表（附件 3）；

2. 加盖单位公章的营业执照复印件；

3. 经审计的 2018 年度财务报告原件或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，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见附件 4，相关岗位的主要人员均需附详细个人简历）；

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；

6. 最近三年无重大违法违规记录的承诺书（附件 5）；

7. 做市业务技术系统情况的说明；

8. 期货、期权交易或者仿真交易做市情况的说明；

9. 交易所要求提供的其他材料（公司的基本情况，包括但不限于股东、注册资本、注册地址、办公地址以及成立时间等基本信息说明，期货公司风险管理子公司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的复印件）。

四、参赛流程

（一）材料报送

申请材料需以电子版和书面形式提交。除甲醇期货做市商选拔赛申请表（附件 1）需在 4 月 20 日前提交外，其他申请材料需在 6 月 20 日前提交。材料报送要求：

1. 电子材料打包发送至指定邮箱，文件名统一为“XX 公司甲醇期货做市商申请材料”，其中第 1、2、3、6 项提供扫描件，其他材料提供电子版及其首页（加盖公章）扫描件；

2. 纸质材料顺序以上述编号为准，每项均需加盖申请单位公章，有多页材料的项目在首页加盖即可，并附上材料清单。

电子材料和纸质材料提交后均需致电确认。对于已是郑商所期权、期货做市商的申请单位，若原提交申请材料中的 2、4、5、7、8、9 项没有变化，无须再次提交。

（二）仿真交易测试

自审符合申请条件的相关单位，需在 4 月 1 日至 4 月 26 日间在仿真环境进行累计不少于 5 个交易日的做市业务测试（测试要求见附件 2），每日双边报价定单报单量不低于 5 万笔，测试结束后需向交易所提交测试报告，否则不能参与甲醇做市选拔赛。

（三）参加做市选拔比赛

申请单位技术系统通过仿真交易测试的，可以参加甲醇期货做市选拔赛。

（四）材料审核

郑商所根据收到材料对申请单位的条件进行审核。对于申请材料不齐全、不符合要求的，不能参加甲醇期货做市商实盘选拔赛评比。

（五）评价指标

郑商所按持续报价义务完成比例和报价价差对参赛机构进行评价，并参考盈亏情况择优选取甲醇期货做市商。

甲醇期货做市商资格确定后向市场公告。

五、其他

联系电话：0371-65612893，0371-65610312

做市商 QQ 群：422987949，323444743

邮寄地址：郑州市郑东新区商务外环路 30 号期货大厦

邮编：450018；邮箱：lvtong@czce.com.cn

特此通知。

- 附件：1. 郑商所甲醇期货做市商选拔赛申请表
2. 关于甲醇期货做市商申请单位参与仿真交易测试的要求
3. 郑商所做市商资格申请表
4. 做市商岗位设置与人员情况汇总表
5. 承诺书

郑州商品交易所

2019 年 3 月 19 日

附件 1

郑商所甲醇期货做市商选拔赛申请表

申请单位名称		指定交易编码	
所在会员名称		会员号	
做市商负责人姓名		做市业务负责人联系电话	
做市技术系统名称		做市系统开发商	
业务联系人	姓名		部门
	电话		邮箱
<p>本机构承诺实盘前在仿真环境充分测试做市技术系统的功能和稳健性，比赛中遵守交易所各项规定。</p> <p style="text-align: center;">申请单位法定代表人签章： (公章) 年 月 日</p>			
<p>我司已充分了解该申请单位的做市业务准备情况及郑商所实盘交易比赛规则。经评估，该申请机构可以通过我司柜台系统参与实盘选拔赛。</p> <p style="text-align: center;">会员法定代表人签章： (公章) 年 月 日</p>			

附件 2

关于甲醇期货做市商申请单位参与仿真交易测试的要求

为测试申请单位做市技术系统功能和稳健性，甲醇期货做市商申请单位应参加郑州商品交易所（以下简称郑商所）在仿真环境组织的相关测试活动，具体安排如下：

一、测试时间

4月1日至4月26日间在仿真环境进行累计不少于5个交易日、每日双边报价定单报单量不低于5万笔的做市业务测试。

二、参与对象

符合申请条件的甲醇期货做市商申请单位。

三、测试要求

（一）于2019年3月26日前将《郑商所甲醇期货做市商业仿真交易测试申请表》扫描件发送至指定邮箱（申请表见附件2.1，需致电确认）；

（二）做市交易编码由申请单位指定；

（三）在仿真环境通过双边报价指令为CF907合约提供双边报价，双边报价最大报价价差不得超过该合约最小变动价位的5倍（25元/吨），最小挂单量不得低于10手；

（四）做市商指定交易编码初始资金为 1000 万元，交易持仓限额与普通客户持仓限额相同；

（五）测试结束后 3 个交易日内向郑商所提交相应测试报告及所在期货公司意见。

四、其他

联系电话：0371-65612893，0371-65610312

做市商 QQ 群：422987949，323444743

邮箱：lvtong@czce.com.cn

附件 2.1：郑商所甲醇期货做市商业业务仿真交易测试申请表

附件 2.1

郑商所甲醇期货做市商业业务仿真交易测试申请表

申请单位名称		指定交易编码（仿真）	
所在会员名称		会员号	
做市商负责人姓名		做市业务负责人联系电话	
做市技术系统名称		做市系统开发商	
业务联系人	姓名		部门
	电话		邮箱
<p>本单位承诺提供信息真实有效，能够按照交易所相关要求在仿真环境棉花期货合约上全面测试技术系统功能及其稳健性。</p> <p style="text-align: right;">单位盖章： 年 月 日</p>			

附件 3

郑商所做市商资格申请表

申请单位名称		申请做市品种	
所在会员名称		会员公司联系人及电话	
法人代表姓名		组织机构代码	
做市商负责人姓名		做市业务负责人联系电话	
做市技术系统名称		做市技术系统开发商	
业务联系人	姓名		部门
	电话		邮箱
<p>本机构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。</p> <p>特此声明。</p> <p style="text-align: center;">申请单位法定代表人签章：</p> <p style="text-align: center;">（公章）</p> <p style="text-align: center;">年 月 日</p>			
<p>经审核，该机构所提供材料符合交易所有关规定。</p> <p style="text-align: center;">会员法定代表人签章：</p> <p style="text-align: center;">（公章）</p> <p style="text-align: center;">年 月 日</p>			

附件 4

期权做市商岗位设置与人员情况汇总表

注：本表为信息汇总表，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
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	
	(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 5

承诺书

郑州商品交易所：

根据《郑州商品交易所做市商管理办法》，本公司承诺自 2016 年 7 月以来无重大违法违规行为，未因重大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。

特此承诺！

公司名称（加盖公章）：

2019 年 xx 月 xx 日