首次申请为期权合约品种提供做市服务的，应向本所提交下列材料：

1. 经法定代表人签字并加盖单位公章的做市商业务申请书，须包含用于做市业务的资金规模，如有后续变更应及时向本所报备；

2. 加盖单位公章的营业执照副本复印件；

3. 合约品种做市业务申请表（见附件1）；

4. 做市业务实施方案、做市业务风险控制制度及有关内部管理制度（必备参考要点见附件2）；

5. 负责做市业务的部门、岗位设置、人员情况说明（做市业务人员情况表请见附件3），若负责做市业务的负责人和联络人出现调整，应及时向本所报备；

6. 开展做市的技术系统准备情况；

7. 中国证监会或本所规定的其他材料。

其中，第1至3项需加盖公章后以书面形式报送本所。申请机构的法定代表人和经营管理的主要负责人应在业务申请书上签字，并做出如下承诺：申请人提交的申请材料内容真实、准确、完整，如存在虚假记载、误导性陈述和重大遗漏，将承担相关法律责任。

做市商申请为其他合约品种提供做市服务的，仅需填写《合约品种做市业务申请表》（附件1）并加盖单位公章后，以书面方式提交至本所。若用于做市的资金规模有变化的，应在再次申请时提交变化情况说明。

附件1

合约品种做市业务申请表

|  |  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- |
| 做市商简称 |  | | 做市商代码 | |  | |
| 做市交易单元 |  | | A股证券账号 | |  | |
| 做市资金规模 |  | | 生效日期 | | *格式YYYY-MM-DD* | |
| 申请品种做市业务信息 | | | | | | |
| 标的证券 | 做市类别 | 权利仓持仓限额（张） | | 总持仓限额（张） | | 单日买入开仓限额（张） |
| 简称（代码） |  |  | |  | |  |
| 做市业务  联络人 | 姓名 |  | | | | |
| 部门 |  | | | | |
| 电话号码 |  | | | | |
| 邮箱 |  | | | | |
| 负责人声明  及签字  （需加盖公章） |  | | | | | |

附件2

做市业务实施方案与管理制度必备参考要点

|  |  |  |
| --- | --- | --- |
|  | **必备章节** | **必备内容参考** |
| **股票期权做市业务实施方案** | | |
| 1 | 做市业务总体设想 | 涵盖投入股票期权做市业务的资金规模及用途、投入人员及详细情况 |
| 2 | 做市策略 | 涵盖定价模型、不同情况下的报价策略、对冲策略、存货管理策略 |
| 3 | 做市系统的基本功能 | 涵盖做市策略交易、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 |
| 4 | 做市报价价差与参与率管理 | 涵盖报价差、报价数量、合约覆盖情况，连续竞价、开盘、收盘、盘中熔断、涨跌停情况下的参与情况 |
| 5 | 数据管理 | 涵盖做市数据库所包括的数据内容、访问权限管理等 |
| 6 | 做市策略预期评价结果及盈亏测算 | 涵盖每日按合约、按标的测算做市评价预期结果等 |
| **内部管理制度** | | |
| 1 | 业务运行管理 | 涵盖做市业务运行管理各要素等 |
| 2 | 合规与内部控制 | 涵盖授权管理机制、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 | 涵盖公司层面对做市业务的监管措施等 |
| 4 | 额度管理 | 涵盖公司内部对做市持仓限额申请流程等 |
| 5 | 责任人及其职责管理 | 涵盖做市业务相关部门、岗位人员及其职责管理等 |
| **风险控制制度** | | |
| 1 | 公司层面与部门层面风控的独立性 | 公司层面的风控措施和部门层面的风控措施，两者每日定期核对机制 |
| 2 | 保证金管理 | 涵盖保证金监控、强行平仓管理 |
| 3 | 市场风险管理 | 涵盖希腊值管理，波动率曲线（面），隔夜风险管理，市场大幅波动的管理等 |
| 4 | 合约到期及行权风险管理 | 涵盖快到期头寸管理，大头针风险管理，行权违约风险管理 |
| 5 | 操作风险管理 | 涵盖持仓、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 |
| 6 | 模型风险管理 | 涵盖模型失效下的应对等 |
| 7 | 流动性风险管理 | 涵盖流动性风险的应对方式等 |
| 8 | 预警设置 | 涵盖持仓限额、每秒申报单数等 |
| 9 | 盈亏管理 | 涵盖日间与日终的盈亏计算等 |
| 10 | 技术风险管理 | 涵盖技术系统风险种类、处理方式等 |
| 11 | 压力测试及报告 | 在不同场景下的保证金、收益及报价情况的压力测试，含极端市场情况，极端场景须详述 |
| **应急预案** | | |
| 1 | 突发事件情形与分类 | 涵盖突发事件的情形、分类 |
| 2 | 预警及响应机制 | 涵盖预警机制、响应机制及流程 |
| 3 | 应急处理方式 | 涵盖各类应急处理方式及流程 |

备注：除上述必备章节和内容外，做市商还应根据做市业务实际需要，制定、明确其他相关制度或预案。

附件3

做市业务人员情况表

|  |  |  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- |
| 公司信息 | 公司名称 | |  | | | | |
| 做市资格类型 | |  | | | | |
| 做市业务  负责人 | 姓名 |  | | | | | |
| 部门 |  | | | | | |
| 电话 |  | | | 邮件地址 | |  |
| 做市业务  联络人 | 姓名 |  | | | | | |
| 部门 |  | | | | | |
| 电话 |  | | | 邮件地址 | |  |
| **部门与岗位设置** | | | | | | | |
| （部门名称1）工作职责包括：  （1） | | | | | | | |
| 岗位 | 人员姓名 | 职责描述 | | 联系方式 | | 工作履历 | |
| （负责人） |  |  | | （座机）  （手机）  （邮件） | | （年份-单位-职责） | |
| （部门名称2）工作职责包括：  （1） | | | | | | | |
| 岗位 | 人员姓名 | 职责描述 | | 联系方式 | | 工作履历 | |
|  |  |  | |  | |  | |
| （部门名称3）工作职责包括：  （1） | | | | | | | |
| 岗位 | 人员姓名 | 职责描述 | | 联系方式 | | 工作履历 | |
|  |  |  | |  | |  | |

备注：做市部门负责人、交易岗、风险控制岗必须详细填写工作履历。