

上海黄金交易所做市商管理办法

第一章 总 则

第一条 为规范上海黄金交易所（以下简称“交易所”）做市商管理，促进市场功能发挥，维护相关市场流动性需求，根据《上海黄金交易所交易规则》的有关规定制定本办法。

第二条 本办法中做市商是指经交易所认可，在指定的交易模式及交易合约上，为市场提供可成交买卖报价等服务的机构。

第三条 本办法中的交易模式包括竞价交易、询价交易、报价交易等。

第四条 本办法适用于交易所做市商的做市及相关活动，交易所、做市商、会员及业务参与机构应当遵守本办法。

第二章 做市商资格

第五条 交易所可在指定的交易模式及交易合约上引入做市商，并向市场公布。

第六条 申请做市商资格的机构应当具备下列条件：

- （一）净资产不低于5千万元人民币或等额外币；
- （二）在交易所或其它同类公开市场的交易能力位居前列；
- （三）具有专门机构和人员负责做市交易，做市人员应当熟悉相关法律法规和交易所业务规则；
- （四）具有健全的做市交易实施方案、内部管控制度和风险管理制度；
- （五）拥有具备做市功能的交易系统及其他基础设施；确保自身

具有足够的连续做市能力以及风险承担能力；

(六) 有较强的贵金属市场研究和分析能力；

(七) 最近三年无重大违法违规记录；

(八) 交易所规定的其他条件。

第七条 申请做市商资格的机构应当提供下列书面材料：

(一) 上海黄金交易所做市商资格申请表；（附件一）

(二) 营业执照复印件（加盖单位公章）；

(三) 做市业务的内部管理制度、操作规程及风控管理办法；

(四) 做市交易部门情况说明（包括相关人员履历、岗位设置、职责划分等）；

(五) 做市交易技术系统情况说明；

(六) 申请时上一年度在交易所或同类市场的交易情况报告；

(七) 最近三年无重大违法违规记录说明；

(八) 经审计的最近一期财务会计报告复印件（加盖单位公章）；

(九) 交易所要求提供的其他材料。

第八条 申请经交易所批准后，涉及协议签署的，申请人应当自收到交易所通知之日起 10 个交易日内，与交易所签订相关交易模式及交易合约的做市商协议（以下简称协议），取得相应的做市商资格。

第九条 做市商有下列情形之一的，交易所可以取消其某一交易合约上的做市商资格：

(一) 未完成协议中约定的做市义务；

(二) 不再满足本办法第六条规定的做市商资格条件；

(三) 交易所认定或者协议约定的其他情形。

第十条 做市商有下列情形之一的，交易所可以取消其所有交易

模式及交易合约的做市商资格：

- （一）存在重大违法违规行为；
- （二）被列为市场禁止进入者；
- （三）依法被收购、兼并、撤销、解散或者宣告破产；
- （四）向交易所提交虚假材料；
- （五）交易所认定或者协议约定的其他情形。

第十一条 做市商放弃做市商资格，应当提前二个月向交易所提出申请。

第十二条 做市商放弃或者被取消做市商资格的，自交易所通知其失去资格之日起，其与交易所签订的协议自动终止。

第三章 做市交易

第十三条 交易所做市商按交易模式分类主要包括：

（一）竞价市场做市商。是指在竞价市场合约中进行买卖报价，以增强交易流动性的机构。

（二）询价市场做市商。是指在询价市场持续提供买、卖双边可成交报价的机构。

（三）报价市场做市商。是指在交易时间内，为报价市场合约提供连续双边报价的机构。

第十四条 报价市场做市商应当使用专用交易席位开展报价业务。

第十五条 竞价市场和报价市场合约的报价内容包括合约代码、买入价、卖出价和价格对应的可成交数量。

第十六条 市场出现下列情形之一的，做市商可以不履行双边报价义务：

- （一） 交易合约出现涨跌停板时；
- （二） 交易所认定的其他情形。

以上情形消失后，做市商应当继续进行双边报价。

第四章 权利和义务

第十七条 做市商享有以下一个或多个权利：

- （一） 交易手续费减收；
- （二） 日内报单、撤单、大额报撤单笔数不做限制；
- （三） 产品合作与创新支持；
- （四） 交易所认定或者协议中约定的其他权利。

第十八条 做市商应履行以下一个或多个义务：

- （一） 连续报价，维持市场买卖价格与流动性；
- （二） 回应报价；
- （三） 满足单笔报价量要求；
- （四） 满足连续报价时长要求；
- （五） 交易所认定或者协议约定的其他义务。

第十九条 做市商因异常情况无法履行做市义务，或拟提前终止协议时，应当提前二个月向交易所提交书面报告并说明原因。

第二十条 对于提前终止协议的做市商，交易所将取消其做市商资格，并在三年内不再接受其做市商资格申请。

第五章 监督管理

第二十一条 做市商不得进行内幕交易、市场操纵、欺诈等违法违规行为，或者谋取其他不正当利益。

第二十二条 交易所可以按交易模式及交易合约，对做市商做市情况进行评价、排名和调整，并对相关情况进行公布。交易所根据协议约定，对做市商的做市效果进行定期考评。

第二十三条 对于未按交易所规定及协议约定履行做市义务的做市商，交易所可以采取以下措施：

- （一） 口头提醒；
- （二） 书面通知，限期整改；
- （三） 终止协议，取消做市商资格；
- （四） 交易所认定的其他措施。

第二十四条 对存在违规交易行为的做市商，交易所可根据掌握的情况，取消其做市商资格，并依据交易所相关规定进行处罚。

第二十五条 做市商应当建立健全的信息技术管理制度及应急处理机制，及时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工作。

第二十六条 做市商需按交易所要求，定期或不定期提交市场运行和做市情况报告。

第二十七条 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、重大事项变更等情况进行监督和检查，做市商应当予以协助和配合。

第六章 附则

第二十八条 本办法未尽事项按照交易所相关制度执行。

第二十九条 银行间黄金询价市场做市商按照《银行间黄金询价市

场做市商管理办法》执行。

第三十条 各交易模式可根据自身业务特点制定有关业务细则。

第三十一条 本办法解释权属于上海黄金交易所。

第三十二条 本办法自公布之日起施行。

上海黄金交易所做市商资格申请表

填表日期

申请机构全称				
注册地址				
通信地址				
注册资金				
净资产规模				
交易模式		做市品种		
做市合约				
申请类型		首次 <input type="checkbox"/>	续期 <input type="checkbox"/>	中止 <input type="checkbox"/>
做市期限		长期 <input type="checkbox"/>	规定期限:	
做市业务 负责人	姓名		岗位	
	电话		手机	
	E-mail		所处城市	
做市业务 联系人	姓名		岗位	
	电话		手机	
	E-mail		所处城市	
近三年有无重大违法违规记录				
其他需要说明的情况		(可附页)		
申请机构声明		本机构申请成为上海黄金交易所竞价市场 xx 品种 (合约) 的做市商, 承诺遵守国家法律法规、遵守上海黄金交易所相关业务规则与业务规范性文件, 遵守与上海黄金交易所签署的做市协议, 认真履行申请品种的做市义务。		
申请机构盖章				

	<p>盖章： 日期：</p>
--	--------------------