

平安银行金融交易部

本币旗舰店一期需求说明书

日期	版本	修订人	评阅人	修订说明
20201125	V1.0	周琳	毕海花	

1 需求背景

平安银行金融交易部计划利用银行间本币旗舰店开展二级市场债券和利率互换利差报价。平安银行的二级现券和互换利差报价基于策略交易团队的定价技术和多年来的做市经验，本次业务主要集中于对曲线利差和跨品种利差进行报价。

2 需求范围说明

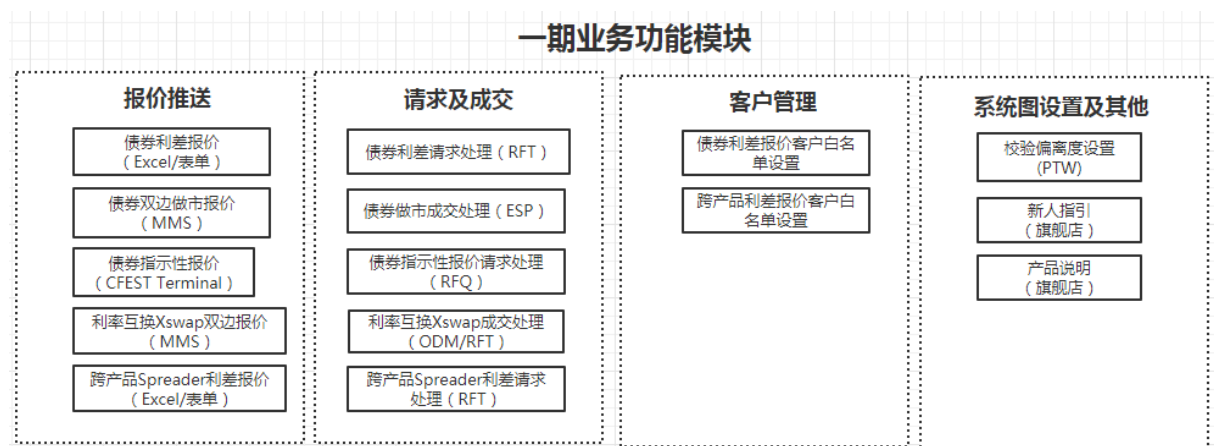
2.1 业务功能模块图

平安银行本币旗舰店整体包含报价推送、请求及成交处理、客户管理及系统设置四大模块，需要支持的业务包含：

债券利差报价(RFT)、债券双边做市报价(ESP)、债券指示性报价(RFQ)。

互换双边报价(ODM/RFT)、期限互换报价(ODM/RFT)、基准互换利差报价(ODM/RFT)

债券-互换利差报价(RFT)。



2.2 整体业务流程

2.2.1 债券利差报价

- 1) 平安银行金融交易部（本文档简称 PAB Dealer）通过报价终端推送报价信息；
- 2) 系统将报价推送到旗舰店终端，并向拥有限权客户展示报价；
- 3) 客户点击报价并向 PAB Dealer 发起请求，旗舰店调系统后台接口尝试生成利差请求，若利差请求生成失败，旗舰店拒绝客户请求并提示拒绝原因；
- 4) 若利差请求生成成功，旗舰店再以客户名义，调银行间接口向 PAB 发送两笔对话报价（简称 RFT），系统后台收到两笔 RFT 后，自动接受两笔 RFT 请求，利差请求状态同步更新；
- 5) 系统自动接受两笔 RFT 后，报价终端同步更新报价量；

2.2.2 债券双边做市报价

PAB Dealer 通过领航做市表单定义债券列表并推送双边做市报价信息，本币终端展示债券双边做市报价，并提供接口将平安银行的债券双边做市报价推送给平安银行旗舰店终端，客户点击双边做市报价时，系统将调用银行间现有模块尝试点击成交(ESP)。

2.2.3 债券指示性报价

PAB Dealer 通过本币终端推送债券指示性报价，本币终端展示债券指示性报价，并提供接口将平安银行的债券指示性报价推送给平安银行旗舰店终端，客户选择指示性报价，尝试发起请求报价（简称 RFQ），系统将调用银行间现有界面及接口尝试发起请求。

2.2.4 利率互换及期限/标的互换双边报价

PAB Dealer 通过领航做市表单定义利率互换及期限/标的互换列表并推送双边报价信息，本币终端展示利率互换及期限/标的互换的双边报价，并提供接口将平安银行的互换和期限互换双边报价推送给平安银行旗舰店终端，客户点击双边报价时，系统将调用银行间现有 Xswap 成交模块尝试点击成交(ODM)。

若中心不支持开放 Xswap 的 ODM 点击成交接口，则旗舰店客户尝试发起对话报价(RFT)，系统将调用银行间现有界面及接口尝试发起对话报价请求。我方交易员收到对话报价请求后，自动确认成交。客户可在旗舰店查看成交结果。

2.2.5 跨产品利差报价

- 1) 平安银行金融交易部（本文档简称 PAB Dealer）通过报价终端(Excel/表单)推送报价信息；
- 2) 系统将报价推送到旗舰店终端，并向拥有权限客户展示报价；
- 3) 客户点击报价并向 PAB Dealer 发起请求，旗舰店调系统后台接口尝试生成利差请求，若利差请求生成失败，旗舰店拒绝客户请求并提示拒绝原因；
- 4) 若利差请求生成成功，旗舰店再以客户名义，调银行间接口向 PAB 发送两笔对话报价（简称 RFT），系统后台收到两笔 RFT 后，可自动接受两笔 RFT 请求（或交易员手工接收两笔 RFT），利差请求状态同步更新；
- 5) 债券与利率互换的两笔 RFT 请求，需要发给同一个交易员。若其中一笔拒绝，则两笔都拒绝；若自动确认，则两笔都确认。
- 6) 系统自动接受两笔 RFT 后，报价终端同步更新报价量；

3 非功能性需求

3.1 安全要求

客户通过本币终端登录平安银行旗舰店，旗舰店前端与系统后台需要通过加密技术来保证通道

的安全。

3.2 性能要求

需要满足本币中心提出的以下性能指标要求：

- ✓ Widget 的 FPS 平均值不能低于 30FPS；
- ✓ Widget 内存峰值不超过 80M；
- ✓ Widget 使用后静止 30 分钟内存涨幅不超过 5%；
- ✓ 每秒 REST/http/https 请求小于等于 1 次；
- ✓ 每秒 Socket 请求小于等于 5 次；
- ✓ 平均内存使用不能超过 50M；
- ✓ 每秒接收数据总量小于等于 10KB【指专线总传输量】

3.3 应急处理

- ✓ 系统后台利差报价服务与利差报价终端需持续检查心跳，若报价终端异常，所有报价自动失效；
- ✓ 旗舰店前端和系统后台需持续检查心跳，若后台服务异常，前端所有报价自动失效；

3.4 灾备需求

PAB 领航交易系统存在灾备，但旗舰店客户端暂不在一期交付中构建灾备。