**青岛清算所风控系统一期建设项目**

**业务访谈调研**

访谈对象：钟磊

访谈人：陈力杰 郭海洋

访谈时间： 2017/9/18 10:30 地点：办公室

* **调研访谈目的**

重点对用户当前的风控进行需求调研，满足用户对系统风险的管控机制；

收集、整理、汇总对现有风险管理方面的意见和建议，并了解未来部门对风控系统的期望。

* **访谈内容**

1. 了解清算所大致业务
   1. 以大宗类OTC业务为主，权益类和发售类较少
2. 大致了解大宗类和权益类
   1. 大宗：连续交易
   2. 权益类：一次性转让，如资产转让，拍卖，权益等的转让
3. 清算所在交易中所起的作用
   1. 不同于上海清算所得中央对手业务，青岛清算所更多的是做结算方，交易机构在清算所开立资金账户，由清算所负责结算业务，
4. 监控：预警，不允许价格偏离外盘过多
   1. 目前清算所没有一定的预警机制，没有预警相关的报表
   2. 清算所的平台期望是能够对接到交易机构的用户，但是目前只对接了1家的交易明细数据，交易明细数据是在盘后进行传送。
5. 用户希望能够（动态）设立预警指标，根据不同的条件对预警条件进行设计。