1. 固收业务动态调整涉及到的参数

持仓规模→持仓规模规模增长比例

逆回购规模→逆回购规模增长比例

1.正回购规模由三部分构成 （1）+（2）+（3）

（1）固收卖出回购中将购回日为指定期限内对应的所有购回金额加总除以1个亿

（2）固收现券持仓中所有券的**公允价值**求和除以1万再乘以指定情景（轻度，中度，重度），指定期限（1D,7D,14D,1M）下的持仓规模增长比例

（3）固收买入返售中将返售日为指定期限内对应的所有返售金额加总除以1个亿再乘以指定情景（轻度，中度，重度），指定期限（1D,7D,14D,1M）下的逆回购规模增长比例

2.持仓规模只由一部分构成

（1）固收现券持仓中所有券的公允价值求和除以1万再乘以1加指定情景（轻度，中度，重度），指定期限（1D,7D,14D,1M）下的持仓规模增长比例之和

3.逆回购规模只由一部分构成

（1）固收买入返售中将返售日为指定期限内对应的所有返售金额加总除以1个亿再乘以指定情景（轻度，中度，重度），指定期限（1D,7D,14D,1M）下的逆回购规模增长比例与1之和

4.到期解付券由三部分构成 （1）+（2）+（3）

（1）将固收质押债券券种表到期解付券（交易所或银行间）的相应券种乘以指定情景（轻度，中度，重度），指定期限（1D,7D,14D,1M）下的质押率规模增长比例后加总除以1个亿。（其中，相应券种包含：国债、中央银行票据，信用评级AAA级的信用债券，金融债券、地方政府债，信用评级AAA级以下，AA-级（含）以上的信用债券）

（2）固收现券持仓中所有券的公允价值求和除以1万再乘以指定情景（轻度，中度，重度），指定期限（1D,7D,14D,1M）下的持仓规模增长比例

（3）固收买入返售中将返售日为指定期限内对应的所有返售金额加总除以1个亿再乘以指定情景（轻度，中度，重度），指定期限（1D,7D,14D,1M）下的逆回购规模增长比例

5.剩余可用券由两部分构成 （1）-（2）

（1）将固收质押债券券种表持仓可用券（交易所或银行间）的相应券种乘以指定情景（轻度，中度，重度），指定期限（1D,7D,14D,1M）下的质押率规模增长比例后加总除以1个亿。（其中，相应券种包含：国债、中央银行票据，信用评级AAA级的信用债券，金融债券、地方政府债，信用评级AAA级以下，AA-级（含）以上的信用债券）

（2）固收买入返售中将返售日为指定期限内对应的所有返售金额加总除以1个亿再乘以指定情景（轻度，中度，重度），指定期限（1D,7D,14D,1M）下的逆回购规模增长比例

1. 交易衍生品业务动态调整涉及到的参数

持仓规模→持仓规模规模增长比例

逆回购规模→逆回购规模增长比例

1.正回购规模由三部分构成 （1）+（2）+（3）

（1）Chris卖出回购中将购回日为指定期限内对应的所有购回金额加总除以1个亿

（2）Chris现券持仓中所有券的公允价值求和除以1万再乘以指定情景（轻度，中度，重度），指定期限（1D,7D,14D,1M）下的持仓规模增长比例

（3）Chris买入返售中将返售日为指定期限内对应的所有返售金额加总除以1个亿再乘以指定情景（轻度，中度，重度），指定期限（1D,7D,14D,1M）下的逆回购规模增长比例

2.持仓规模只由一部分构成

（1）Chris现券持仓中所有券的公允价值求和除以1万再乘以1与指定情景（轻度，中度，重度），指定期限（1D,7D,14D,1M）下的持仓规模增长比例之和

3.逆回购规模只由一部分构成

（1）Chris买入返售中将返售日为指定期限内对应的所有返售金额加总除以1个亿再乘以指定情景（轻度，中度，重度），指定期限（1D,7D,14D,1M）下的逆回购规模增长比例与1之和

4.到期解付券由三部分构成 （1）+（2）+（3）

（1）将Chris质押债券券种表到期解付券（交易所或银行间）的相应券种乘以指定情景（轻度，中度，重度），指定期限（1D,7D,14D,1M）下的质押率规模增长比例后加总除以1个亿。（其中，相应券种包含：国债、中央银行票据，信用评级AAA级的信用债券，金融债券、地方政府债，信用评级AAA级以下，AA-级（含）以上的信用债券）

（2）Chris现券持仓中所有券的公允价值求和除以1万再乘以指定情景（轻度，中度，重度），指定期限（1D,7D,14D,1M）下的持仓规模增长比例

（3）Chris买入返售中将返售日为指定期限内对应的所有返售金额加总除以1个亿再乘以指定情景（轻度，中度，重度），指定期限（1D,7D,14D,1M）下的逆回购规模增长比例

5.剩余可用券由两部分构成 （1）-（2）

（1）将Chris质押债券券种表持仓可用券（交易所或银行间）的相应券种乘以指定情景（轻度，中度，重度），指定期限（1D,7D,14D,1M）下的质押率规模增长比例后加总除以1个亿。（其中，相应券种包含：国债、中央银行票据，信用评级AAA级的信用债券，金融债券、地方政府债，信用评级AAA级以下，AA-级（含）以上的信用债券）

（2）Chris买入返售中将返售日为指定期限内对应的所有返售金额加总除以1个亿再乘以指定情景（轻度，中度，重度），指定期限（1D,7D,14D,1M）下的逆回购规模增长比例

1. 两融业务动态调整涉及到的参数

业务规模→业务规模规模增长比例

客户还款→客户还款率规模增长比例

资产售卖可融资规模→可售卖比例规模增长比例

1.业务规模扩张由一部分构成

（1）两融业务情况表中最新日期的融资规模除以1个亿再乘以指定情景（轻度，中度，重度），指定期限（1D,7D,14D,1M）下的业务规模规模增长比例

2.客户还款由一部分构成

（1）两融业务情况表中最新日期的融资规模除以1个亿再乘以指定情景（轻度，中度，重度），指定期限（1D,7D,14D,1M）下的客户还款率规模增长比例

3.可售卖资产由5部分构成 （1）+（2）-（3）-（4）-（5）

（1）两融业务情况表中最新日期的融资规模除以1个亿

（2）两融业务情况表中最新日期的融资规模除以1个亿再乘以指定情景（轻度，中度，重度），指定期限（1D,7D,14D,1M）下的业务规模规模增长比例

（3）出表规模为43

（4）两融业务情况表中最新日期的融资规模除以1个亿再乘以指定情景（轻度，中度，重度），指定期限（1D,7D,14D,1M）下的客户还款率规模增长比例

（5）两融售卖明细合约中实际到期日期大于指定期限（1D,7D,14D,1M）的资产求和除以1个亿

4.资产售卖可融资规模

（1）可资产售卖乘以指定情景（轻度，中度，重度），指定期限（1D,7D,14D,1M）下的可售卖比例规模增长比例

1. 股票质押业务动态调整涉及到的参数

业务规模扩张→业务规模规模增长比例

资产售卖可融资规模→可售卖比例规模增长比例

1.业务规模扩张由一部分构成

（1）将股票质押项目明细中购回日期大于等于固收买入返售日期加指定期限（1D,7D,14D,1M），并且交易模式为“股票质押式回购”的融资余额求和除以1个亿再乘以指定情景（轻度，中度，重度），指定期限（1D,7D,14D,1M）下的业务规模规模增长比例

2.资产售卖可融资规模由两部分构成 （1）+（2）

（1）将股票质押项目明细中购回日期大于等于固收买入返售日期加指定期限（1D,7D,14D,1M），并且营业部为“”的融资余额求和除以1个亿再乘以指定情景（轻度，中度，重度），指定期限（1D,7D,14D,1M）下的可售卖比例规模增长比例

（2）将股票质押项目明细中购回日期处于固收买入返售日期加指定期限（1D,7D,14D,1M）内，并且营业部为“带回购\*”的融资余额求和除以1个亿再乘以指定情景（轻度，中度，重度），指定期限（1D,7D,14D,1M）下的可售卖比例规模增长比例