

# 中国金融期货交易所

## 2018 年度计划课题委托研究公告

为发动社会各界研究力量，共同推进金融衍生品市场发展相关问题的研究，中国金融期货交易所（以下简称我所）即日起启动 2018 年度计划课题的委托研究申报工作。现将课题申报的有关事项说明如下：

### 一、选题及研究内容

2018 年度计划课题围绕金融衍生品行业发展，结合市场和实体经济的需要，共设立 8 个选题，具体研究内容如下：

#### 1、公司制交易所自律监管中的会员参与问题研究

从基础理论角度分析公司制交易所中会员的法律地位，梳理境外主要公司制交易所的会员结构与标准，研究境外公司制交易所对会员的持续监管机制及各类会员在公司制交易所业务规则制定、客户管理和市场风险控制等自律监管中承担的角色和发挥的作用，总结在自律监管中引入会员参与、防范利益冲突的国际经验，并分析我国公司制交易所完善会员参与机制的路径与方法。

#### 2、境外金融期现货市场交易制度研究

从交易制度与市场效率、价格发现、风险控制的关系出发，分析交易制度的协调性对期现货市场间良性互动的影响，梳理境外成熟金融期货和现货市场交易制度间的协调关系，并对完善我国金融期现货市场交易制度提出建议。

### 3、大数据背景下金融期货市场风险监测与预判研究

利用互联网大数据和文本分析、机器学习等数据挖掘方法，分析金融期货市场价格波动及微观结构变化与市场环境变化间的联系，量化金融期货市场风险，构建风险监测指标体系，结合境外经验案例，对我国金融期货市场风险监测、预研预判等量化管理提出建议。

### 4、金融期货服务实体经济的路径和案例研究

结合全球金融期货市场发展历史与我国发展实践，通过理论分析和案例剖析，研究股指期货、国债期货在服务实体经济发展、助推多层次资本市场体系建设、促进金融市场稳定运行等方面的微观机理、作用路径和宏观意义，并对如何深化金融期货市场功能发挥提出建议。

### 5、金融期货在健全社会主义现代金融体系中的作用研究

十九大报告提出，“着力加快建设实体经济、科技创新、现代金融、人力资源协同发展的产业体系”。结合十九大报告等对我国经济金融工作的总体部署，分析社会主义现代金融体系的内涵、构成要素、建设目标等，并结合我国金融期货市场运行和功能发挥情况，多维度分析金融期货市场在健全社会主义现代金融体系中的作用。

### 6、全面开放背景下期货市场跨境监管与执法协作研究

全面梳理和研究境外期货市场在跨境监管法律法规建设与执法协作实践情况，分析在我国金融市场扩大开放进程中期货市场跨境监管与执法协作面临的问题和挑战，并提出有效实施跨境监管与执法协作的建议。

## 7、金融市场脆弱性与我国金融期货市场建设研究

在金融要素市场不确定性显著增加、金融市场运行内外部环境日趋复杂的大背景下，从金融脆弱性理论和国外案例研究出发，全面评估我国金融市场脆弱性状况及其影响因素，系统分析金融期货（按股票、债券、外汇等标的划分）市场对防范我国金融市场脆弱性与保障金融稳定的功能意义、微观影响及具体机制，基于金融市场脆弱性理论提出我国金融期货市场发展建议。

## 8、母子公司财务管理模式研究

通过对国内外广泛应用的母子公司财务管理模式、转让定价模式等方面的研究，深入分析各模式的优缺点、适用条件等，并结合我所母子公司定位、经营管理模式、税收管理等实际情况，从人员管理、公司运行、财务管理、转让定价模式、未来发展等方面，分别展开研究分析，并给出可行性方案和建议。

### 二、申报条件与方式

1、申报单位包括政府监管部门或行业自律组织、高校及科研院所、各类研究平台或智囊机构，以及银行、保险、证券、基金和期货等各类市场机构，不接受个人名义的申报。

2、申报单位可自主选择合作方组成跨单位的课题组，开展联合研究。

3、课题负责人为课题研究的直接责任人，必须有能力、有时间真正承担课题的组织工作，并指导和参与课题研究。

4、申报单位最多可申报两个课题，但只能承担一个课题。欢迎

提前与我所联系人充分沟通，以便准确把握选题内容。

5、申报单位请填写附件《课题计划书》，加盖单位公章后不晚于2018年6月30日邮寄至我所，同时将《课题计划书》电子文档发送至我所联系人邮箱。

### 三、承接单位选择与课题经费

1、我所将按照“公开招募、择优选取”的原则，通过专家评审的方式对各单位提交的申报材料进行评审，综合申报单位资质、主要参与人员研究水平、课题研究思路和篇章结构的科学性等各方面因素，择优确定课题承接单位。

2、课题承接单位与我所签订课题委托协议后开始进入研究阶段。

3、课题研究期限原则上为自协议签订之日起6个月。

4、上述课题的经费均为10万元。

### 四、联系方式

邮寄地址：上海市浦东新区世纪大道1600号陆家嘴商务广场7楼（200122）

联系人：何 鹏

电子邮件：[hepeng@cffex.com.cn](mailto:hepeng@cffex.com.cn)

联系电话：021-50160637

中国金融期货交易所

2018年5月30日