



讓交易更簡便

# 交易對手方 對沖政策

MITRADE GLOBAL PTY LTD

2020年11月9日

LEVEL 13, 350 QUEEN STREET,  
MELBOURNE, VIC 3000, AUSTRALIA

WWW.MITRADE.COM  
CS@MITRADE.COM

風險警示：差價合約 (CFD) 是槓桿性產品，有可能導致您損失全部投資資金。這些產品並不適合所有人。敬請在使用我們的服務前仔細閱讀產品披露聲明 (PDS)、金融服務指南 (FSG)、風險披露聲明和客戶協議，並確保在交易前充分了解所涉及的風險。您並不實際擁有或持有任何相關基礎資產。

ABN 90 149 011 361 | AFSL NO. 398528

## 簡介

1. 本文件內容詳細解釋 Mitrade Global Pty Ltd (以下簡稱“Mitrade”“我們”，“我方”，“我們自身”等) 為管理市場風險以及設立因對沖交易對手方而承受的風險敞口上限而使用的具體方法。本政策的制定根據澳大利亞證券及投資委員會(ASIC) 的監管指南 (Regulatory Guide) RG227制定。
2. 信用風險是指因Mitrade 的交易對手方無法履行其義務而導致Mitrade蒙受財務損失的風險。Mitrade的信用風險管理旨在當我們的銀行或經紀商在流動性、信用質量或償債能力出現突然變化時保護公司自身和客戶的利益。
3. 為方便客戶能即時執行交易, Mitrade主要承擔市場風險,因此市場風險上限通常來說非常保守。
4. 本文件涵蓋有關Mitrade如何處理以下風險的內容：
  - (I) 市場風險;
  - (II) 信用風險; 和
  - (III) 選擇和評估對手方交易

## 市場風險的緩解,監控和上報

5. 我們不會基於自身對市場走勢的預測建立倉位。然而並非所有客戶的倉位都會被對沖,因此 MITRADE 可能在其提供的任一市場的☒品中持有淨倉位,也因此 MITRADE 就剩餘未對沖的倉位承受其市場風險。
6. 我們有內部市場風險管理流程並對每個客戶交易的市場以及我們認為有可能相關的交易市場群體設定限度。這些內部規定將限制我們客戶交易活動的淨餘敞口上限並且確保我們的對沖活動符合我們的風險偏好。
7. 我們風險管理系統可持續實時地監控公司自身的風險敞口,以防超出限度。如果由於客戶的交易活動導致我們的風險敞口超過限制,我們將採取對衝從而使敞口恢復到限制範圍內。
8. 任何內部市場風險的流程改動都必須經過董事會的批准。

## 信用風險緩解和上報

9. 我們有內部交易對手方信用風險評估流程,以評估其信用風險以及風險上限。該流程每年會復核,任何的變動將提交給董事會批准。
10. 我們將持續復核我們主要對手方的信用質量,每年至少有一次針對每個交易對手方的正式風險評估。如果市場變動大或者有相關的新聞,我們會更頻繁復核交易對手方。
11. 我們將每日監控每個交易對手方的風險敞口,並彙報給交易部門主管 (Head of Dealing)。
12. 我們的政策是通過多樣化以及對每個交易對手方設立風險上限來減少對手方的違約風險。

## 交易對手方的選擇標準

13. 我們採用一系列的指標來評估我們潛在的對沖對手方，以確保他們有足夠的財務實力。
14. 除非我們的潛在對沖對手方滿足以下條件，否則我們不會採用：
  - 有充足的財務和合規資源
  - 在當地有金融服務牌照
  - 客戶資金存放在聲譽良好的銀行；以及
  - 在金融服務行業有良好聲譽
15. 增加新的交易對手方以及/或任何現有對交易對手方的風險上限的修改，需要經過Mitrade的董事會批准。

## 目前交易對手方名單

16. 目前與我們合作的交易對手方如下：
  - IS Prime Limited;
  - FXCM;
  - CFH Clearing Ltd; 以及
  - X-Trade Brokers DM S.A.
17. 如果您需要更多信息，歡迎聯系我們 [cs@mitrade.com](mailto:cs@mitrade.com)。



**MITRADE GLOBAL PTY LTD**

---

LEVEL 13,  
350 QUEEN STREET,  
MELBOURNE, VIC 3000,  
AUSTRALIA

[WWW.MITRADE.COM](http://WWW.MITRADE.COM) | [CS@MITRADE.COM](mailto:CS@MITRADE.COM)