

业务运营平台-衡泰 xIR 系统 2023 年升级改造项目

单一来源采购方式公示

一、项目信息

采购人：固定收益部

项目名称：业务运营平台-衡泰 xIR 系统 2023 年升级改造

拟采购的货物或服务的说明：2019 年之后，中国外汇交易中心陆续开放了平台各交易品种的上行接口，会员单位可选择对接 CFETS 电子化接口进行银行间上行交易。目前我司自营银行间现券匿名 X-Bond 和质押式回购匿名 X-Repo 依赖于手工下单，交易成本及交易效率瓶颈凸显，成为阻碍我司银行间现券类和资金类交易业务发展的症结。在公司自营优化大类资产配置、丰富盈利模式的要求背景下，公司自营固收银行间市场的品种和交易规模不断扩大，打通银行间业务的电子化接口，进行匿名报价的策略量化交易，增强交易效率、降低交易成本，成为了目前阶段业务破局发展的迫切需求。基于此，衡泰 xIR 利率资产管理系统作为自营固收银行间市场的交易通道，需向上打通到外汇交易中心的交易及行情电子化接口，向下为 FICC 量化交易系统提供交易及行情接入服务。另外，为了满足数据报送和监管改造要求，此项目还包含对衡泰 xIR 系统深交所报价回购合约管理、中证协监管报表、银行间债券借贷下行成交、上交所固定收益平台接口的改造建设。

采用单一来源采购方式的原因及说明：银行间债券借贷下行接口 CSTP、上交所固定收益平台接口 EZDA 及报价回购合约管理改造，为衡泰 xIR 系统原有业务的接口及簿记管理改造建设；为保证现有银

行间交易业务的连续性，X-Bond 最优报价行情及 X-Repo 交易接口改造需要在原有外汇交易中心上行接口程序中支持，衡泰 xIR 系统需要提供行情及交易服务供 FICC 综合业务系统接入；目前固收业务的监管报表统一在衡泰 xIR 生成，为了保持使用习惯，并考虑开发成本和监管报送数据要求的严谨性，在原系统中开发支持。衡泰 xIR 系统为固收全资产簿记系统，此次升级改造符合公司固收自营业务系统的统一规划。根据《财通证券股份有限公司采购管理办法》第十八条（二），必须保证原有采购项目一致性或者服务配套的要求，需要继续从原供应商处采购的，可以采用单一来源方式采购。

二、拟定供应商信息

名称：杭州衡泰技术股份有限公司

地址：杭州市西湖区教工路 23 号百脑汇科技大厦 12 层

三、公示期限

2023 年 12 月 08 日至 2023 年 12 月 15 日

四、其他补充事宜：

无

五、凡对本次采购的采购方式存疑的，请按以下方式联系。、

1. 采购人

联系人：熊伟

联系地址：杭州市西湖区天目山路财通双冠大厦西 18 楼

联系电话：18268148066