

# 2021 年广州金控博士后招聘选题

(经 2021 年 6 月 15 日集团党委会和总经理办公会审议通过)

## 一、构建科学高效的金融控股集团公司治理体系研究

研究目标: (1) 梳理国际主流经济体和我国金融监管框架中对金控集团在公司治理方面的要求, 总结统一协调监管模式下金控集团公司治理体系的基本框架和构成要素; (2) 围绕金控集团的业务体系, 构建符合集团业务结构特征的组织架构, 并确立与该组织架构相匹配的董事会和高管职责; (3) 梳理金控集团下属金融企业董事、监事、高级管理人员及风控、合规、财务负责人的任职管理要求, 建立符合监管要求的人员委派机制; (4) 依据集团下属不同业务子公司的业务经营特点与监管要求, 构建符合公司特征的考核与激励机制; (5) 构建符合金控集团业务板块特征和关联交易监管要求的业务协同与协同激励机制。

## 二、广州金控金融科技发展研究

研究目标: (1) 探寻在当前以央行征信和大数据征信为主体的市场结构下, 地方金融控股平台金融科技业务的发展路径与突破口; (2) 研究隐私技术(含联邦学习、多方安全技术、可信计算等)在金融科技、城市治理、社会经济等方面的应用; (3) 挖掘政务数据和市场数据在城市治理、社会信用体系建设及其他社会与经济应用方面的联合场景; (4) 探索政务数据与市场数据在开放、流通和应用等方面的制度

安排。

### **三、推动广州市现代金融业产业链高质量发展研究**

研究目标：（1）分别从科创金融、数字金融、普惠金融、绿色金融等金融业态角度，系统梳理广州市金融业的主要产业链及相关构成主体名单；（2）总结国际主要经济体相关金融产业链的发展路径、发展模式与发展经验；（3）立足广州在粤港澳大湾区的发展定位和传统优势产业，结合国家、省、市对广州市的战略部署，分析广州市发展金融产业所面临的外部竞争环境、宏观经济形势、监管与政策环境，在总结广州发展现代金融业优劣势的基础上，提出广州差异化发展特色金融产业的现代金融产业链布局；（4）围绕所提出的金融产业链布局规划，探索通过整合现有金融资源、推进与国内其他金融市场互联互通和引进或新设一批优势金融机构等综合举措来提升广州市金融业整体竞争力的工作方案。

### **四、以广州期货交易所设立为契机，推动广州市期货产业发展研究**

研究目标：（1）梳理芝加哥、纽约、伦敦、法兰克福、新加坡、香港等全球主要期货交易所的代表性期货品种及其系列衍生品，比较国内外期货市场在产品结构、衍生品数量、交易规模等方面的差异，总结全球主要期货市场在产品创新、风险管理和交易机制设计等方面的经验；（2）立足广州在全国和粤港澳大湾区发展格局中的定位，围绕广州市的产业结构和未来产业规划，探索适合广州期货交易所的创新交易品

种；（3）围绕广州期货交易所可能推出的创新交易品种，探索与之相关的证券公司做市商业务、期货公司资产管理与风险管理业务、基金公司量化对冲策略、保险公司“期货+保险”业务等的业务模式；（4）立足期货市场的价格发现和风险对冲功能，结合广州金融市场的发展特色，提出依托广州期货交易所打造全球风险管理中心的方案建议。

## 五、金控集团全面风险管理体系的构建与金融科技在现代风险管理系统中的运用研究

研究目标：（一）金控集团全面风险管理体系建设目标及方案，具体包括：（1）大型金融集团全面风险管理体系的构建思路与方案总结；（2）全面风险管理体系的相关指标选择；（3）对全面风险管理体系的建设成果和运行效果提出可量化的监测和评估指标；（二）探索金控集团风险偏好体系的建设思路，具体包括：（1）金控集团稳健的风险偏好体系基本框架设计；（2）风险偏好在集团内部的传导机制；（3）风险偏好的监测与评估。（三）结合国内监管机构对金控集团的监管思路，探索金融科技在金控集团现代风险管理系统建设中的运用，具体包括：（1）系统梳理金融科技在国内主流金控集团的运用情况；（2）梳理主流金控集团或金融主体内部信息科技及业务管理系统的建设情况；（3）探索金融科技与风险管理体系的融合模式；（4）探索我司运用金融科技建设与完善集团风险管理体系的目标和重点方向。

## 六、金融支持实现碳中和、碳达峰战略目标的工具与

## 方法研究

研究目标：（1）总结欧盟、英国、美国、韩国等世界主要碳交易所的发展历程、交易机制、交易品种及相关的金融衍生品创新；（2）在总结我国碳交易市场的发展历程、发展现状、交易机制等方面内容的基础上，借鉴国际碳交易市场的发展经验，围绕习总书记提出的“3060目标”，提出构建全国统一碳市场的基本体系框架；（3）围绕我国碳交易所涉及的行业，提出符合行业特征的初始分配市场、现货市场和期货市场的配额确定、定价方式、交易机制及相关的创新型碳金融产品；（4）围绕广州碳排放权交易所和广州期货交易所的参与主体、交易品种和交易机制，探索增强市场流动性的做市商制度设计和金融机构参与模式。