

附件 1:

信用风险缓释工具备案材料具体要求

一、开展自营投资管理业务的金融机构备案成为核心交易商或一般交易商的材料

金融机构参与者有意成为银行间市场信用风险缓释工具核心交易商或一般交易商的，应向交易商协会秘书处提交加盖机构公章的下列备案材料：

(一) 备案说明书；

备案说明书需包括以下内容：

1. 备案意向；

2. 相关业务部门情况简介；

包括岗位设置、人员简历、职责划分等情况，并应包括金融衍生产品交易部门、风险管理部门的情况，以及相关部门从业人员从业经验和业务资格能力的情况。

3. 最近 2 年无违法和重大违规行为的书面说明；

4. 最近 2 年本机构在银行间市场的相关业务情况说明，包括从事金融衍生产品业务的情况，以及金融衍生产品定价估值能力的情况。

(二) 最近年检的《营业执照》的副本复印件；

(三) 《金融许可证》副本复印件等证明文件；

(四) 金融管理部门批准开展衍生产品业务的相关证明文件；

(五) 信用风险缓释工具内部操作规程和风险管理制度；

应当至少包括业务授权与分工、交易执行与管理、风险测算与监控、信用事件触发后的处置、风险报告和内部审计等内容。

(六) 上一年末净资产规模的相关文件;

(七) 交易商协会要求提供的其他材料。

二、开展资产管理业务的管理人备案成为一般交易商的材料

资产管理产品管理人参与者有意成为银行间市场信用风险缓释工具一般交易商的,应向交易商协会秘书处提交加盖机构公章的下列备案材料:

(一) 备案说明书;

备案说明书需包括以下内容:

1. 备案意向;

2. 相关业务部门情况简介;

包括岗位设置、人员简历、职责划分等情况。

3. 最近2年无违法和重大违规行为的书面说明;

4. 最近2年在银行间市场的相关业务情况说明;

5. 资产管理产品符合投资协议约定的投资范围情况说明;

(二) 最近年检的《营业执照》的副本复印件;

(三) 《金融许可证》的副本复印件(如有),或相关自律组织出具的私募投资基金管理人备案证明文件副本;

(四) 关于资产管理业务的信用风险缓释工具内部操作规程和 risk 管理制度;

应当至少包括业务授权与分工、交易执行与管理、风险测算与监控、信用事件触发后的处置、风险报告和内部审计等内容。

(五) 符合投资协议约定投资范围的资产管理产品名单及每

只资产管理产品的产品规模信息；

（六）对于未来新增符合投资协议约定投资范围的资产管理产品，管理人只需提交相应的资产管理产品名单及每只资产管理产品的产品规模信息；

（七）交易商协会要求提供的其他材料。

三、开展自营投资管理业务的非金融机构备案成为一般交易商的材料

其他非金融机构参与者有意成为银行间市场信用风险缓释工具一般交易商的，应向交易商协会秘书处提交加盖机构公章的下列备案材料：

（一）备案说明书；

备案说明书需包括以下内容：

1. 备案意向；

2. 相关业务部门情况简介；

包括岗位设置、人员简历、职责划分等情况。

3. 最近2年无违法和重大违规行为的书面说明；

4. 最近2年本机构在银行间市场的相关业务情况说明；

（二）最近年检的《营业执照》的副本复印件；

（三）公司章程，以及董事会批准开展信用风险缓释工具业务的相关证明文件；

（四）最近一期的经审计的财务报表；

（五）信用风险缓释工具内部操作规程和风险管理制度；

应当至少包括业务授权与分工、交易执行与管理、风险测算与监控、信用事件触发后的处置、风险报告和内部审计等内容。

(六) 交易商协会要求提供的其他材料。

四、核心交易商备案成为信用风险缓释凭证创设机构

核心交易商有意成为银行间市场信用风险缓释凭证创设机构的，应在核心交易商备案材料的基础上，进一步向交易商协会秘书处提交加盖机构公章的下列备案材料(备案材料可以单独提供，或与其他备案材料一并提供)：

(一) 备案说明书；

备案说明书需包括以下内容：

1. 备案意向；
2. 相关业务部门情况简介；

包括岗位设置、人员简历、职责划分等情况，需满足《指引》要求的“具有从事信用风险缓释凭证业务的专业人员，并配备必要的业务系统和信息系统”及“具有较强的信用风险管理和评估能力，有丰富的信用风险管理经验，并配备5名以上(含5名)的风险管理人员”。

(二) 上一年末净资产不少于40亿元人民币的证明文件；

(三) 信用风险缓释凭证创设内部操作规程和业务管理制度；应当至少包括业务授权与分工、创设执行与管理、风险测算与监控、信用事件触发后的处置、风险报告和内部审计等内容。

(四) 交易商协会要求提供的其他材料。

五、核心交易商备案成为信用联结票据创设机构

核心交易商有意成为银行间市场信用联结票据创设机构的，应在核心交易商备案材料的基础上，进一步向交易商协会秘书处提交加盖机构公章的下列备案材料(备案材料可以单独提供，或

与其他备案材料一并提供):

(一) 备案说明书;

备案说明书需包括以下内容:

1. 备案意向;
2. 相关业务部门情况简介;

包括岗位设置、人员简历、职责划分等情况,需满足《指引》要求的“具有从事信用联结票据业务的专业人员,并配备必要的业务系统和信息系统”及“具有较强的信用风险管理和评估能力,有丰富的信用风险管理经验,并配备5名以上(含5名)的风险管理人员”。

(二) 上一年末净资产不少于40亿元人民币的证明文件;

(三) 信用联结票据创设内部操作规程和业务管理制度;

应当至少包括业务授权与分工、创设执行与管理、风险测算与监控、信用事件触发后的处置、风险报告和内部审计等内容。

(四) 交易商协会要求提供的其他材料。