

附件 1:

## 银行间市场凭证类信用风险缓释工具 信息披露操作须知

### 一、信息披露文件的提交

#### (一) 公开创设

##### 1、受理平台

创设机构应当将拟披露的凭证类信用风险缓释工具(以下统称凭证类产品)信息披露文件提交“中国银行间市场交易商协会(以下简称交易商协会)综合业务和信息服务平台”(以下简称 NAFMII 平台)的信息披露服务系统,由 NAFMII 平台统一受理后,在交易商协会网站、中国货币网、银行间市场清算所股份有限公司(以下简称上海清算所)网站和北京金融资产交易所有限公司(以下简称北金所)网站披露。

信用事件触发公告抄送交易商协会、全国银行间同业拆借中心(以下简称交易中心)和上海清算所的,发送至本操作须知所附相关单位指定邮箱。

##### 2、提交时间

对于创设信息披露,创设机构应当于披露日上午 10:00 之前在 NAFMII 平台的信息披露服务系统提交文件。其中,与债券联动创设的,提交时间应当与标的债券信息披露文件提交时间保持一致。需要披露信用风险缓释凭证预配售公告的,创设机构应当至少在标的债券申购截止时间前 1 个小时提交相关文件。

对于创设过程中变更信息披露文件的，创设机构应当至少在原凭证类产品申购截止时间前 1 小时在 NAFMII 平台的信息披露服务系统提交文件。

对于存续期定期披露、存续期重大事项披露和信用事件触发的信息披露，创设机构应当于披露日当日在 NAFMII 平台的信息披露服务系统提交文件。

## （二）定向创设

### 1、受理平台

对于信用风险缓释凭证，现阶段由创设机构与特定投资人指定电子邮箱进行定向披露。创设机构应当在创设说明书中明确信息披露指定邮箱、信息披露时间安排、变更指定邮箱的方式、系统故障后备机制以及业务联系人等信息。投资人应当在申购文件中指定其接受信息披露邮箱和业务联系人等信息。二级市场买入凭证的投资人，应当根据创设说明书中列明的创设机构联系信息，在不晚于买入当日书面告知创设机构其接受信息披露邮箱和业务联系人等信息。投资人变更联系方式的，应当主动告知创设机构。

此外，创设机构应当将拟披露文件同步提交 NAFMII 平台的凭证类产品创设备案及销售系统（以下简称 NAFMII 备案及销售系统）的信用风险缓释凭证模块，并发送至交易中心和上海清算所在本操作须知中所附指定邮箱。

对于信用联结票据，创设机构应当将拟披露文件提交 NAFMII 备案及销售系统的信用联结票据模块，并发送至交易中心和上海清算所在本操作须知中所附指定邮箱。投资人通过 NAFMII 备案

及销售系统接受信息披露。

信用事件触发公告抄送交易商协会、交易中心和上海清算所的，发送至本操作须知所附相关单位指定邮箱。

## **2、提交时间**

与公开创设的披露文件提交时间标准一致。

## **二、信息披露材料格式**

除创设机构的主体信用评级报告（如有）应当加盖中介机构单位公章外，其他信息披露文件应当加盖创设机构单位公章。已上市的创设机构通过 NAFMII 平台的信息披露服务系统披露信息网页链接或用文字注明其披露途径的，相关说明文件应当加盖创设机构单位公章。

## **三、创设结果及交易报备**

### **（一）创设结果信息报备**

创设机构应当在凭证类产品登记日后 1 个工作日内通过 NAFMII 备案及销售系统进行凭证类产品创设结果信息报备。

### **（二）二级市场交易信息报备**

在交易中心达成的凭证类产品交易，应当由交易中心于每个工作日结束后将当日的凭证类产品交易明细送交易商协会。未在交易中心达成的凭证类产品交易，应当由凭证类产品卖方通过 NAFMII 平台的信用风险缓释工具交易备案及信息系统向交易商协会报备交易明细。

## **四、应急处理**

因系统故障等原因无法按时提交信息披露文件的，创设机构应当将拟披露文件以电子邮件方式发送至北金所指定邮箱。

电子邮件应当符合以下要求：

- （一）通过创设机构的相关预留邮箱发送；
- （二）邮件名称完整且与信息披露材料文件名称一致；
- （三）邮件内容中应当注明信息披露联系人及联系方式。

交易商协会联系方式：

文件接收指定邮箱：crmti@nafmii.org.cn

电话：010-66539205； 010-66539143

传真：010-66539028

交易中心联系方式：

文件接收指定邮箱：zqss@chinamoney.com.cn

电话：021-38585311

上海清算所联系方式：

文件接收指定邮箱：fx@shclearing.com

电话：021-23198888

传真：021-63326661

北金所联系方式：

文件接收指定邮箱：xxpl@cfae.cn

电话：010-57896927； 010-57896636

传真：010-57896763