**二级市场交易信用衍生品培训班（第五期）**

**课程安排**

|  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- |
| **序号** | **时长** | **课程名称** | **课程内容** | **具体讲师** |
| 1 | 0.5小时 | 国际信用衍生产品市场发展动态 | 本课程介绍国际信用衍生产品市场发展动态，包括信用衍生品内含、作用、发展历史脉络，信用衍生品市场现状，包括按参考实体行业、评级、合约期限、合约种类介绍市场特点以及信用衍生品市场主要参与者情况。 | 交易规范部 |
| 2 | 0.5小时 | 信用风险缓释工具产品简介 | 向市场参与者介绍信用风险缓释工具（CRM）产品，包括发展历程、发展思路、制度框架、产品特色交易要素、基础产品结构。 | 交易规范部 |
| 3 | 0.5小时 | 信用风险缓释工具资质备案与交易备案 | 向市场参与者介绍我国信用风险缓释工具市场入市备案及交易备案流程，为其参与银行间市场信用风险缓释工具业务提供实务操作方面的信息参考。 | 交易规范部 |
| 4 | 0.5小时 | 凭证类信用风险缓释工具信息披露与报备 | 本课程基于《银行间市场信用风险缓释工具试点业务规则》、《信用风险缓释凭证业务指引》和《关于银行间市场凭证类信用风险缓释工具信息披露有关事项的通知》等制度，从实操角度对凭证类信用风险缓释工具的信息披露流程和操作细节进行讲解，帮助市场参与者直观的了解信息披露的全过程并开展相关业务。 | 交易规范部 |
| 5 | 0.5小时 | CLN产品简介及应用 | 向市场参与者介绍CLN产品简介及应用有关情况，从产品定义和结构、产品应用和业务流程等维度介绍CLN产品基本情况，为市场成员开展CLN业务提供信息参考。 | 交易规范部 |
| 6 | 1小时 | 信用衍生品的估值方法 | 本课程主要介绍无套利原理和衍生产品定价，信用债券的无套利定价以及信用衍生品的估值等相关知识。 | 市场专家 |
| 7 | 1小时 | CRM基本术语与适用规则 | 本课程从CRWA、CRMW、CDS、CLN对信用风险缓释工具进行介绍；CRM基本术语与适用规则包括通用术语、信用事件有关术语、结算相关术语。 | 市场专家 |
| 8 | 2.5小时 | CDS在中国市场的需求和应用研究 | 本课程以信用衍生品的合规、法律、风控、清算、财务五大业务要素为框架，首先介绍了国内外信用衍生品市场的组织机构体系，法律协议制度，回溯了国际信用衍生品市场的发展历史；其次对信用衍生品的交易要素、市场情况、发展意义等进行业务说明；最后对于信用衍生品在中国的发展历程，及金融机构发展信用衍生品业务的模式进行了阐述。 | 市场专家 |
| 9 | 0.5小时 | 信用风险缓释凭证登记结算规则和系统功能介绍 | 本课程从业务规则、机制、流程三个方面介绍上海清算所信用风险缓释凭证登记托管结算业务，便利市场参与者创设和投资信用风险缓释凭证。 | 市场专家 |

**二级市场交易协议文本培训班（第五期）**

**课程安排**

|  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- |
| **序号** | **时长** | **课程名称** | **课程内容** | **具体讲师** |
| 1 | 0.5小时 | 《NAFMII主协议》核心机制安排简介 | 本课程主要介绍《NAFMII主协议（2009年版）》的单一协议、净额结算、履约保障这三项核心机制安排。 | 交易规范部 |
| 2 | 0.5小时 | 《NAFMII主协议》主要条款介绍 | 本课程主要介绍《NAFMII主协议（2009年版）》的主协议、补充协议、履约保障文件、定义文件的主要情况，重点介绍违约事件、违约事件的处理、争议的解决等重要条款。 | 交易规范部 |
| 3 | 0.5小时 | 《NAFMII主协议》的备案与自律管理 | 在市场成员已基本了解《NAFMII主协议（2009年版）》核心机制和主要条款的基础上，帮助市场成员了解《NAFMII主协议》的备案要求和流程。 | 交易规范部 |
| 4 | 0.5小时 | 《回购主协议》核心机制安排简介 | 本课程主要介绍《债券回购主协议（2013年版）》的核心机制安排，包括：盯市调整、替换、单一协议及终止净额。 | 交易规范部 |
| 5 | 0.5小时 | 《回购主协议》主要条款介绍 | 本课程主要介绍《债券回购主协议（2013年版）》的主要条款，包括：通用条款、质押式回购特别条款、买断式回购特别条款。 | 交易规范部 |
| 6 | 0.5小时 | 《回购主协议》的备案与自律管理 | 本课程在市场成员已基本了解《回购主协议》核心机制和主要条款的基础上，帮助市场成员了解《回购主协议》的备案要求与流程。 | 交易规范部 |
| 7 | 1小时 | 回购交易案例分析 | 本课程向市场参与者介绍中国银行间债券回购市场的主要特征，回购交易典型案例与处置规则，并通过实例介绍为其参与银行间市场债券回购交易与处理相关违约事件提供制度依据与实务操作方面的信息参考，以进一步助力回购市场规范发展，参与主体高效、合规维护债权债务。 | 市场专家 |

**二级市场交易自律规则体系建设及业务规范培训班（第五期）**

**课程安排**

|  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- |
| **序号** | **时长** | **课程名称** | **课程内容** | **具体讲师** |
| 1 | 0.5小时 | 银行间债券市场运行情况及架构设计 | 本课程主要介绍银行间债券市场运行基本情况、管理框架、业务种类、协会交易自律规则体系建设及自律管理工作总体情况等内容。 | 交易规范部 |
| 2 | 1小时 | 银行间债券市场交易自律规则介绍 | 本课程主要介绍银行间债券市场交易自律规则相关条款及制定考虑，以及协会近年来二级市场自律管理工作开展情况等内容 | 交易规范部 |
| 3 | 1小时 | 银行间市场现券做市业务自律指引及评价指标体系介绍 | 本课程主要介绍银行间债券市场现券做市业务指引及评价指标体系修订背景，具体条款制定考虑，评价指标展示及应用，以及相关案例解析等内容。 | 交易规范部 |
| 4 | 1小时 | 银行间市场货币经纪业务自律指引介绍 | 本课程主要介绍银行间市场货币经纪业务开展情况，经纪业务自律指引具体条款介绍，以及相关案例解析等内容。 | 交易规范部 |
| 5 | 0.5小时 | 现金要约收购业务介绍 | 本课程主要介绍现金要约收购业务的机制设计及具体业务流程规范 | 交易规范部 |
| 6 | 0.5小时 | 银行间债券市场交易行为信息档案介绍 | 本课程主要介绍银行间债券市场交易行为信息档案数据收集范围、豁免情形、信息查询等内容。 | 交易规范部 |
| 7 | 0.5小时 | 交易即时通讯工具规范使用相关工作介绍 | 本课程主要介绍协会关于规范使用交易即时通讯工具相关自律要求等内容 | 交易规范部 |