附件：

**中国银行间市场交易商协会2021年“NAFMII研究计划”课题立项名单**

|  |  |  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- |
| **课题编号** | **课题名称** | **选题类别** | **研究单位** | **联合研究单位** | **课题负责人** | **课题负责人职务** | **课题组成员** |
| KFKT2021-001 | 境外债券发行制度与实务研究 | 1 | 汇丰银行（中国） |  | 王生、叶善扬 | 汇丰银行（中国） 环球银行联席主管；汇丰银行（中国）债务资本市场负责人 | 吴影颀、柳嘉真、张春雷、张嘉洋、李大山 |
| KFKT2021-002 | 信用债发行人信息披露与债券违约的关联性研究 | 1 | 信永中和会计师事务所 |  | 李杰 | 信永中和会计师事务所 合伙人 | 孟祥军、罗玉成、贺鹏、陈乃玉 |
| KFKT2021-003 | 债券市场风险监测预警防控机制研究 | 1 | 顺德农商行 |  | 宋球红 | 顺德农商行 研究所 副所长 | 林玲、张宁昕、何晓静 |
| KFKT2021-004 | 地方国有企业和城投平台债券融资风险防控的实践与方向 | 1 | 国信证券 |  | 李峰 | 国信证券 固定收益事业部 业务董事 | 唐珊 |
| KFKT2021-005 | 债券市场违约处置机制研究——公司债违约责任国内外司法实践比较 | 1 | 清华大学国家金融研究院绿色金融发展研究中心 |  | 黎菁 | 清华大学 国家金融研究院 研究员 | 盛峰、彭景怡、张慧钰 |
| KFKT2021-006 | 我国公司信用类债券市场发行人债券购回操作及意义分析 | 1 | 进出口银行 |  | 赵鹰 | 进出口银行 资金营运部 副总经理 | 喻斌、郭谦和、孙一霏、张剑桥、赵晓燕、王菁华 |
| KFKT2021-007 | 债券市场违约处置机制研究 | 1 | 中诚信国际 |  | 吕寒 | 中诚信国际 副总裁 | 王娟、袁海霞、黄雨昕、余璐、谭畅、孙晓曼、张堃 |
| KFKT2021-008 | 债务重整融资工具 | 1 | 招商证券 |  | 荣希 | 招商证券 固定收益融资部 执行董事 | 马涛、赵鑫、范泽宇 |
| KFKT2021-009 | 高收益债估值方法及交易、处置机制分析——基于债券兑付风险与特殊机会投资视角的分析 | 1 | 东兴证券 |  | 刘宸宇、陈吕栋 | 东兴证券 债券业务总部 总经理；债券业务一部 总经理 | 黄卉、汪玲、郭松磊、吴婧 |
| KFKT2021-010 | 债券市场支持乡村振兴战略——通过金融供给侧改革理论视角推进完善债券融资服务 | 2 | 农业发展银行 |  | 田丰 | 农业发展银行 投资部 总经理 | 程海峰、郑菁然、王特、邹博文、解玥、李奇 |
| KFKT2021-011 | 助力乡村振兴票据高质量发展研究 | 2 | 广发银行 |  | 王晓灼 | 广发银行 投资银行部 债券承销业务负责人 | 李勘、钟绍豪、王谞达、余令 |
| KFKT2021-012 | 债券融资在“乡村振兴”中的作用机制研究 | 2 | 徽商银行 |  | 马文伟 | 徽商银行 投资银行部 副总经理 | 贾瑞跃 |
| KFKT2021-013 | 债券市场助力乡村振兴的应用研究 | 2 | 宁波银行 |  | 陈辰 | 宁波银行 投资银行部 总经理 | 柴飞犇、胡哲睿、刘博仁、马沁雪、黄笑添、吴迪超 |
| KFKT2021-014 | 债券市场支持脱贫攻坚有效衔接乡村振兴问题研究——以贵州省为例 | 2 | 贵阳银行 |  | 张正海 | 贵阳银行 董事长 | 张伟、杨荣、张黔蜀、韩卓立、熊智富、杨璟、郭勇、包青荷、魏子杰、王钰舒、赵凌卿、王玉珏、程浩、曾玉辉 |
| KFKT2021-015 | 债券市场支持乡村振兴战略研究 | 2 | 南京银行 |  | 庄英浩 | 南京银行 投资银行部 总经理 | 张悦、马迪、章睿谦、李坤、张国庆 |
| KFKT2021-016 | 债券市场支持乡村振兴高质量发展研究——基于融资企业与项目ESG评级体系的构建与分析 | 2 | 清华大学国家金融研究院绿色金融发展研究中心 |  | 黎菁 | 清华大学 国家金融研究院 研究员 | 邵丹青、陈玉林、龚教伟、刘宸昊 |
| KFKT2021-017 | 关于国际GSS债券实践与境内绿色债券市场接轨的探索 | 2 | 中国银行 |  | 刘林 | 中国银行 投资银行与资产管理部 助理总经理 | 苏博、朱磊、李哲、谢智健、周静、傅吉娜、程派豪、李宋乐颖、王彤 |
| KFKT2021-018 | 环境风险与绿色债券发行利率研究 | 2 | 邮政储蓄银行 |  | 吴恺 | 邮政储蓄银行 投资银行部风险管理处 处长 | 李进、毕含笑、李晨曦 |
| KFKT2021-019 | 绿色债券市场助力“30.60目标”实现及市场完善建议 | 2 | 浦发银行 |  | 刘凌 | 浦发银行 投资银行部 总经理 | 葛馨蔚、赵广志 |
| KFKT2021-020 | 国内外绿色债券市场发展对比研究 | 2 | 邮政储蓄银行 |  | 郑路 | 邮政储蓄银行 投资银行部债券融资处 副处长 | 汪航、姜霄、王思禹 |
| KFKT2021-021 | 碳金融产品体系国际经验研究及国内绿色金融产品创新探索 | 2 | 兴业银行 |  | 陈伟 | 兴业银行 投资银行部 总经理 | 黄硕、周然、蒋娟娟、赵欣乐、张敬石 |
| KFKT2021-022 | “碳达峰”、“碳中和”背景下的绿色债券市场发展研究 | 2 | 渤海银行 |  | 李玥 | 渤海银行 投资银行部 总经理 | 伍军、姜晨、修文昊、李宇 |
| KFKT2021-023 | 债券市场支持碳达峰、碳中和目标研究 | 2 | 大公国际 |  | 吕柏乐 | 大公国际资信 董事长 | 徐黎明、陆思南、李剑、张萌、赵松贺、张梦韵 |
| KFKT2021-024 | 双碳目标下绿色债券评估认证与碳减排测算方法研究 | 2 | 联合赤道 |  | 刘景允 | 联合赤道 绿色金融事业部 总经理 | 王顺利、赵孟颖、吉秋红、陈金龙、常鼎伟 |
| KFKT2021-025 | 风险报酬转移模型在绿色资产证券化应用的实证研究 | 2 | 杭州银行 |  | 袁靖毅 | 杭州银行 投资银行部 副总经理 | 盛辉、冉静、章林强、胡珊、翁琳 |
| KFKT2021-026 | 从发行人角度看非金融企业绿色债券在我国的发展实践 | 2 | 中泰证券 |  | 吴昱 | 中泰证券 债券与结构融资总部 总经理 | 黄宇昌、孙雄飞、李越、翁慧雅、张津、高秋萍、李蓉梅 |
| KFKT2021-027 | 绿色债券的制度创新与实践对策研究 | 2 | 重庆农商行 |  | 阎雁 | 重庆农商行 投资银行部 债券业务负责人 | 肖艳、万逸、张雨怡、朱雨潇、汪洋、明霈 |
| KFKT2021-028 | 生态文明建设产业化过程中投融资研究 | 2 | 东方证券 |  | 李初 | 东方证券 固定收益业务总部 董事 | 洪斯茜、张昆、张驰杰、孙明哲 |
| KFKT2021-029 | 科创类债券降低企业融资成本的机遇与挑战 | 2 | 上海农商行 |  | 骆娅丹 | 上海农商行 投资银行部 副经理 | 王博栋、张沁、陈晰、郭倞祎、蔡盛伟、李浩、李杰玮、宋茹 |
| KFKT2021-030 | 双循环新发展格局下债券支持科技创新的机制设计研究 | 2 | 广东科学技术情报研究所 |  | 陈岚 | 广东科学技术情报研究所 信息传播中心 研究员 | 刘启强、拓晓瑞、尹亮、程露、彭诗渊、林世爵、潘慧、王龙、王彬、孙进、叶伊倩 |
| KFKT2021-031 | 企业降杠杆与债券市场实践-中国市场案例研究 | 2 | 兴业银行 |  | 郭晓恺 | 兴业银行 投资银行部 副总经理 | 黄硕、周然、叶超、杨景坛 |
| KFKT2021-032 | 统一注册模式（DFI）对企业优化负债结构及成本的效用分析——以江西发债企业为例 | 2 | 江西银行 |  | 吴娜 | 江西银行 投资银行部 总经理 | 胡翔、邓磊、付璐、李昌文 |
| KFKT2021-033 | 国有建筑企业调杠杆证券化产品的运用 | 2 | 平安证券 |  | 张究 | 平安证券 投资银行事业部 执行副总经理 | 杨侃、谢磊柯、岑寅、李刚、符天豪、唐雯、彭天成、陈子楠、王凯 |
| KFKT2021-034 | 新形势下民企融资途径探讨 | 2 | 国泰君安 |  | 杨鹏 | 国泰君安 债务融资部 副总经理 | 赵青、肖卓然 |
| KFKT2021-035 | 债券市场供应链金融应用路径探索 | 2 | 浙商银行 |  | 沈滨 | 浙商银行 投资银行总部 总经理 | 王珏、戴晓燕、黄妙珏、金璘、庄瑾亮、张文祥 |
| KFKT2021-036 | 债券市场支持城市更新研究 | 2 | 光大银行 | 中证鹏元资信评估 | 刘茜、李慧杰 | 光大银行 投资银行部投行政策处 处长；中证鹏元 研发部 总经理 | 陈周睿、陈晓、曹翔、陈颖、蒋川、李秀洁、柯研、高慧珂、吴志武、康正宇、延骁威、喻策 |
| KFKT2021-037 | 城市更新专项债务融资工具的应用研究——基于广州地区改造模式 | 2 | 广州农商行 |  | 王金娥 | 广州农商行 投资银行部 总经理 | 万志刚、张乐、吴谈兵、张雯皓、卢永骏 |
| KFKT2021-038 | 地方政府债券助力公共服务高质量发展研究 | 2 | 南京审计大学 |  | 潘俊 | 南京审计大学 会计学院 教授 | 陈骏、王博森、韦小泉、梅元清、刘书成、赵洵、朱凤萍 |
| KFKT2021-039 | 银行间市场公募REITs研究 | 2 | 民生银行 |  | 张铮 | 民生银行 投资银行部 副总经理 | 陈娜、陈怡慧、詹悦 |
| KFKT2021-040 | WBS全业务资产证券化模式在我国可行路径的研究 | 2 | 东方证券 |  | 谢贇 | 东方证券 固定收益总部 副总经理 | 孔建钧、王伟强、孙明哲 |
| KFKT2021-041 | 浅析资产担保票据 | 2 | 江苏银行 |  | 孙宏 | 江苏银行 投行与资产管理总部 副总经理 | 王伟、胡之波 |
| KFKT2021-042 | 中国债券市场受托管理人制度研究 | 3 | 广发证券 |  | 潘科 | 广发证券 债券业务部 负责人 | 李育成、邱桓沛 |
| KFKT2021-043 | 新《证券法》下债券持有人保护机制研究 | 3 | 长江证券 |  | 徐嘉 | 长江证券 创新融资部 总经理 | 翁冬冬、江磊、付智鹏、黄艳芳、黄静怡、解文昭、陈虎、李潇雨 |
| KFKT2021-044 | 债券持有人会议集体行动与个体权利保护平衡问题研究——以受托管理人信义义务的妥善履行为实现路径 | 3 | 北京汉坤律师事务所 |  | 尤杨 | 北京汉坤律师事务所 合伙人 | 赵之涵、邓晓明、宋泽政、朱志炜、张树祥、高鹏宇、邱玉霞 |
| KFKT2021-045 | 债券受托管理人制度的健全与完善研究 | 3 | 北京天同律师事务所 |  | 何海峰、马更新 | 北京天同律师事务所 合伙人；中国政法大学 民商经济法学院 教授 | 王峰、石睿、郜丹、韩非鹏、陈茗媛、朱泽硕、陈豪鑫 |
| KFKT2021-046 | 地方城商行金融服务方案研究 | 4 | 青岛银行 |  | 林杰夫 | 青岛银行 投资银行部 总经理 | 黄干彪、杜月萍、王潮 |
| KFKT2021-047 | 关于湖南省城投类企业的投行服务研究 | 4 | 长沙银行 |  | 戴浩 | 长沙银行 投资银行部 总经理 | 崔杰、刘钦、王茜、李清、曹维 |
| KFKT2021-048 | 统一债券市场下承销业务模式与竞争格局研究 | 4 | 汉口银行 |  | 邓凯 | 汉口银行 投资银行部总经理 | 程涛、同晨亮、陈晶 |
| KFKT2021-049 | 债券市场评级机构自律管理的国际经验研究 | 4 | 北京银建资信评估事务所 |  | 王海龙 | 北京银建资信评估事务所 产品研发部 负责人 | 吴鑫海 |
| KFKT2021-050 | 人民币国际债券市场支持体系建设研究 | 5 | 建设银行 |  | 钱理红 | 建设银行 投资银行部 总经理 | 吴小隆、宋彦勇、温婧、陈禹、王丽寒 |
| KFKT2021-051 | 中国债市对外开放大趋势下探索外资扩大投资我国信用债比重的研究 | 5 | 浦发银行 |  | 宋瑞波 | 浦发银行 投资银行部 副总经理 | 张嘉怡、倪琴、苏皓、李荣罡、卢东、陈微、姜凌云 |
| KFKT2021-052 | 债券市场开放与人民币国际化研究 | 5 | 海通证券 |  | 路颖 | 海通证券 研究所 所长 | 李明亮、周洪荣、朱蕾、吴一萍、王旭、李姝醒 |
| KFKT2021-053 | 构建债券市场对外开放新格局研究 | 5 | 申万宏源证券 |  | 范为 | 申万宏源证券 固收融资总部 总经理 | 孟祥娟、范思远 |
| KFKT2021-054 | 国内国际双循环背景下中国债券市场国际竞争力研究 | 5 | 郑州银行 |  | 张厚林 | 郑州银行 行长助理 | 张文建、韩宝平、秦昱斐、何根庆、贾蕴琦 |
| KFKT2021-055 | 债券市场运行机制国内外比较研究：海外债券执行实操 | 5 | 德意志银行（中国） |  | 方中睿 | 德意志银行（中国） 债务资本市场部 主管 | 李冰婷、王洛达、权泓丹、陈晨、金一倜 |
| KFKT2021-056 | 境外投资人投资境内绿债的意愿研究 | 5 | 商道绿融 |  | 郭沛源 | 商道绿融 董事长 | 安国俊、关睿、申丽娜、Yuki Yasui、张睿、吴艳静、刘玉俊 |
| KFKT2021-057 | 台资企业银行间市场发债研究 | 5 | 厦门银行 |  | 谢晓明 | 厦门银行 投资银行部 副总经理 | 李腾格勒、郑志超 |
| KFKT2021-058 | 信用分化背景下信用风险缓释工具的应用研究 | 6 | 浦发银行 | 兴银基金 | 宋瑞波、许蔚 | 浦发银行 投资银行部 副总经理；兴银基金 固定收益部 总经理助理 | 陈艳、邹学诚、李文焱、娄恺怡、王然、刘苑秋、叶茂、邓纪超 |
| KFKT2021-059 | 信用风险缓释工具支持资产证券化市场健康发展研究 | 6 | 中信证券 |  | 邹迎光 | 中信证券 固定收益部 行政负责人 | 陈杨、李川、史梁、杨雨霖 |
| KFKT2021-060 | 信用风险缓释工具创新研究 | 6 | 天府信用增进 |  | 余亮 | 天府信用增进 业务发展部 副总经理 | 尹涛、王科力 |
| KFKT2021-061 | 推动信用衍生品业务发展助力中小企业融资服务实体经济 | 6 | 中信证券 |  | 王超男、明明 | 中信证券 债券融资业务 负责人；中信证券 研究所 FICC首席分析师 | 杨昕、李晗 |
| KFKT2021-062 | 量化交易在利率衍生品交易中的应用研究 | 6 | 中信建投 |  | 吴润泽 | 中信建投 固定收益部 自营业务负责人 | 钟点、杨金舟、查启维、张弛、彭子可 |
| KFKT2021-063 | 关于数字债券的研究与展望 | 7 | 上海银行 |  | 茅彦民 | 上海银行 投资银行部 副总经理 | 虞舜博、严亦佳、施煜洲、王力、杜仲 |
| KFKT2021-064 | 注册制下金融科技在信息披露中的应用研究 | 7 | 平安证券 | 平安资管 | 于春洪、刘剑 | 平安证券 总经理助理；平安资管KYZ数据与AI实验室总监 | 李依琳、李川、高祎、卢成、陈俊锜、兰云、包蕾、张骅、高寒冰 |
| KFKT2021-065 | 人工智能技术在债券违约风险监测中的应用研究 | 7 | 长沙农商行 |  | 曹巍 | 长沙农商行 副行长 | 郑凌虹、彭杰 |
| KFKT2021-066 | 金融科技在债券风险防控中的应用研究 | 7 | 中央财经大学金融学院 |  | 姜富伟 | 中央财经大学 金融学院 教授 | 林奕皓、薛浩、张华婧、马甜 |
| KFKT2021-067 | 基于大数据人工智能的债券存续期风险分类研究 | 7 | 平安资管 | 平安证券 | 刘剑、于春洪 | 平安资管KYZ数据与AI实验室总监；平安证券 总经理助理 | 李果夫、张乐情、王超、孙亦冰、杜亚卿、顾君杰 |
| KFKT2021-068 | 金融科技在信用评级业务中的应用研究 | 7 | 大公国际 |  | 范本银 | 大公国际 信息化部 总经理 | 王秋月、张诚坚、王明富、杜伟楠、孟繁策 |
| KFKT2021-069 | 欧美货币市场介绍以及对我国的借鉴意义 | 8 | 国信证券 |  | 董德志 | 国信证券 经济研究所 副所长 | 徐亮 |
| KFKT2021-070 | 永续类债务融资工具的市场定价逻辑和趋势 | 8 | 国信证券 |  | 张佳梦 | 国信证券 固定收益第二事业部债券发行一部 副总经理 | 李虹佳、江之韵 |
| KFKT2021-071 | 地方国企债券违约对区域内企业融资的影响分析 | 8 | 中原银行 |  | 王志远 | 中原银行 投资银行部 副总经理 | 杨阳、唐嵩乔、宋晓阳、陈冲 |
| KFKT2021-072 | 设计发行城投债权类资产支持票据 | 8 | 招商证券 |  | 曹梦珲 | 招商证券 固定收益融资部 董事总经理 | 邓启程、何益煌、张凯 |
| KFKT2021-073 | “双循环”战略背景下金融支持实体经济发展的路径研究 | 8 | 江苏江南农商行 |  | 吴明园 | 江苏江南农商行 投资银行部 总经理 | 李勇、沈菲、睦懿、王均禾、朱一希、朱玉敏、王琦 |
| KFKT2021-074 | 以陕西省为例浅析地方性商业银行对区域信用债市场的影响 | 8 | 长安银行 |  | 解志炯 | 长安银行 副行长 | 高峰、吕祥清、武婷、常捷、牛庆、王瑾、姜美心 |
| KFKT2021-075 | 成渝双城经济圈城投债发行现状与趋势分析 | 8 | 重庆银行 |  | 曾俊 | 重庆银行 投资银行部 总经理 | 钟吉金、张川、熊力、官春洪、张宸铭 |

注：表格第3列各选题方向为：

1. 债券市场基础制度研究；

2. 债券市场助力经济高质量发展研究；

3. 债券市场投资者培育与保护研究；

4. 债券市场中介机构管理与业务创新研究；

5. 构建债券市场对外开放新格局研究；

6. 衍生品市场产品创新和制度建设研究；

7. 金融科技在债券市场的应用研究；

8. 除上述七类选题方向外，其他符合课题研究总体目标的选题。