

附件 2:

## 中国银行间市场交易商协会意向承销类会员（信托公司类）参与承销业务市场评价相关材料要求说明

### 一、材料内容

（一）参与市场评价说明书，须包括以下内容：

1. 机构基本情况介绍，包括：股东情况，基本业务运行情况，近三年监管评级情况，《营业执照》及《金融许可证》变更情况等。

另附：《营业执照》副本及《金融许可证》复印件（如《营业执照》及《金融许可证》自入会以来未发生变更则无需另行提供）。

2. 债券承销业务部门设置及人员配备情况，包括：本机构组织架构图及业务联系等相关说明，债券承销相关业务部门及投资交易相关业务部门的成立时间、部门设置、基本业务范围、业务框架及业务联系、工作机制和流程、人员配备及在本机构的地位和作用等情况。

另附：从事债券承销业务相关人员汇总表（模板见附 1）、从事债券承销业务相关人员工作简历（模板见附 2）、近三年取得能力建设水平测试合格证书的人员名单（模板见附 3）。

3. 债券承销业务相关制度建设情况说明：

（1）关于非金融企业债务融资工具承销业务操作规程的制度说明。

(2)关于非金融企业债务融资工具承销业务风险管理制度的制度说明。

(3)关于非金融企业债务融资工具承销业务内部控制制度的制度说明。

4. 银行间债券市场相关业务开展情况介绍。

(1)上一年度在银行间债券市场上债券投资交易业务开展情况(笔数、金额等)。

(2)上一年度<sup>1</sup>参与资产支持票据业务情况(作为特定目的载体管理机构参与发行金额、只数等)。

另附:上一年度参与资产支持票据发行明细表(模板见附4)、市场评价基本信息表(模板见附5)。

5. 最近三年无违法和重大违规行为的说明。

(二)2016年度审计报告复印件及公告披露的2016年度报告。

(三)中央国债登记结算有限责任公司及银行间市场清算所股份有限公司对本机构(不含理财专户)银行间债券市场债券交割量、债券托管量的证明材料原件。

(四)银监会关于特定目的信托受托机构资格的批复文件复印件。

(五)非金融企业债务融资工具承销业务操作规程,应为本公告之日前本单位正式发布实施的制度,具体详见附6。

(六)非金融企业债务融资工具承销业务风险管理制度,应为本公告之日前本单位正式发布实施的制度,具体详见附6。

---

<sup>1</sup> 鉴于信托型ABN推出时间较短,因此本次市场评价中涉及资产支持票据业务量的统计周期为2016年8月至2017年8月。

(七) 非金融企业债务融资工具承销业务内部控制制度，应为本公告之日前本单位正式发布实施的制度，具体详见附 6。

## 二、材料格式

参与市场评价的会员应当按照《中国银行间市场交易商协会意向承销类会员（信托公司类）参与承销业务市场评价材料清单》（见附件 3）所列顺序将电子版材料（以光盘形式）与纸质版材料提交至交易商协会秘书处。

### （一）电子材料

1. 从事债券承销业务相关人员汇总表应按照 EXCEL 格式，其他可按照 Word 或 PDF 格式提供。

2. 文件夹标题为“XX 信托公司参与承销业务市场评价材料”。

3. 每项评价材料的文件名称和标题一致，并按本说明第一部分列示顺序排序，如“XX 信托公司材料一：参与承销业务市场评价说明书”。

### （二）纸质材料

1. 将材料按照上述列示顺序逐份装订。

2. 材料清单及每份材料均需加盖单位公章。

- 附：
1. XX 信托公司从事债券承销业务相关人员汇总表
  2. XX 信托公司从事债券承销业务相关人员工作简历
  3. XX 信托公司近三年取得能力建设水平测试合格证书人员名单

4. XX 信托公司上一年度参与资产支持票据发行明细表
5. 市场评价基本信息表
6. 非金融企业债务融资工具承销业务相关制度评价说明

附 1:

### XX 信托公司从事债券承销业务相关人员汇总表

序号	姓名	性别	年龄	部门	职务	主要职责	学历	从事债券承 销业务年限	职称及职业 资格	NAFMII 培训情况	工作电话	手机	备注

**填表说明:**

1. 从事债券承销业务相关人员为参评机构在本公告发布之日前正式聘用的专职从事中国债券市场（含各类债券）承销业务的人员。
2. 主要职责为承销业务具体工作明细，如客户营销、尽职调查、制作材料、报备材料、债券销售等，应简单清晰概括主要职责。
3. 从事债券承销业务年限：从事债券承销业务年限应与本人工作简历一致，满一年的按照一年计算，超过半年未满一年的按 0.5 计算，未超过半年的按 0 计算。
4. 职称主要指经济师、会计师等职称，职业资格主要指 CPA、CFA、律师从业资格、证券从业资格以及相关债券业务从业资格等。
5. NAFMII 培训情况，主要指参加交易商协会相关培训次数及培训内容等。
6. 按照 EXCEL 格式编写本表。

附 2:

### XX 信托公司从事债券承销业务相关人员工作简历

1. 姓名:				
时间	单位	部门	职务	职责
2. 姓名:				
时间	单位	部门	职务	职责

**填表说明:**

1. 简历内容从工作之日起算，时间升序排列。
2. 简历排列顺序应与从事债券承销业务相关人员汇总表排列顺序一致。

附 3:

XX 信托公司近三年取得能力建设水平测试合格证书人员名单

序号	姓名	部门	取得证书时间

**填表说明:**

1. 本表仅统计取得能力建设水平测试合格证书（投资银行类）的人员，取得能力建设水平测试合格证书（信用评级类）的人员不需计入本表。
2. 取得证书时间应与能力建设水平测试合格证书的发证日期一致。

附 4:

### XX 信托公司上一年度参与资产支持票据发行明细表

序号	债券简称	发行人名称	发行金额（亿元）	起息日	主承销商	注册金额（亿元）

**填表说明:**

1. 信托公司作为特定目的载体管理机构参与 ABN 的发行金额从债券起息日开始统计。
2. 发行人名称请填写公司全称。
3. 发行金额单位：亿元，保留小数点后两位。
4. 统计周期为公告前 12 个月，即 2016 年 8 月至 2017 年 8 月。

附 5:

市场评价基本信息表

单位名称（全称）：		
净资产（亿元）	2016 年末	
信托资产（亿元）	2016 年末	
银行间债券市场债券交割量（亿元）	2016 年度	
银行间债券市场债券托管量（亿元）	2016 年 1 月 1 日	
	2016 年 6 月 30 日	
	2016 年 12 月 31 日	
参与资产支持票据的发行只数	2016 年 8 月- 2017 年 8 月	
参与资产支持票据的发行金额（亿元）	2016 年 8 月- 2017 年 8 月	
特定目的信托受托机构资格	<input type="checkbox"/> 是	<input type="checkbox"/> 否
从事债券承销业务人员数量		
债券承销业务人员平均从业年限（年）		
近三年取得能力建设水平测试合格证书的累计人数		
经办人：		
单位盖章：		
时 间：		

### 填表说明:

1. 净资产、信托资产数据应与 2016 年度审计报告及公告披露的 2016 年度报告一致。单位: 亿元, 保留小数点后两位。

2. 银行间债券市场债券交割量仅指发生在银行间债券市场的债券交易结算量, 包括现券、质押式回购、买断式回购、远期和借贷交易的交割面额, 本数据以参评机构在中央国债登记结算有限责任公司和银行间市场清算所股份有限公司开设的账户项下数据为准, **不包括相关理财专户等**。具体数据应与中央国债登记结算有限责任公司和银行间市场清算所股份有限公司统计数据保持一致 (**应提供经上述两公司盖章确认的相关数据证明材料**), 数据核对无误后填写。单位: 亿元, 保留小数点后两位。

3. 银行间债券市场托管量指发生在银行间债券市场的债券托管量, 本数据以参评机构在中央国债登记结算有限责任公司和银行间市场清算所股份有限公司开设的账户项下数据为准, **不包括相关理财专户等**。具体数据应与中央国债登记结算有限责任公司和银行间市场清算所股份有限公司统计数据保持一致 (**应提供经上述两公司盖章确认的相关数据证明材料**), 数据核对无误后填写。单位: 亿元, 保留小数点后两位。

4. 参与资产支持票据的发行只数, 是指参评机构作为 ABN 的特定目的载体管理机构, 参与资产支持票据项目的发行单数。

5. 参与资产支持票据的发行金额, 是指参评机构作为 ABN 的特定目的载体管理机构, 参与资产支持票据项目的发行金额。单位: 亿元, 保留小数点后两位。

6. 特定目的信托受托机构资格, 根据参评机构 2016 年度实际情况在表格内打勾选择“是或否”。

7. 从事债券承销业务人员数量, 是指参评机构专门从事中国债券市场 (含各类债券) 承销业务的业务人员, 与参评机构从事债券承销业务相关人员汇总表数据保持一致。

8. 从业人员平均从业年限是指参评机构所有从事债券承销业务人员的平均从业年限 (从业人员平均从事债券承销业务年限=从事债券承销业务年限之和/从事债券承销业务人员数量): 满一年的按照一年计算, 超过半年未满一年的按 0.5 计算, 未超过半年的按 0 计算。

附 6:

## 非金融企业债务融资工具承销业务 相关制度评价指标说明

一、非金融企业债务融资工具承销业务操作规程是指对基本程序、各流程工作要求、组织实施、岗位职责、应急处理等业务的相关规定。

二、非金融企业债务融资工具承销业务风险管理制度是指对风险定义、风险识别、评估与预警、防范与控制、风险缓释、转移与补救等的制度性规定。

三、非金融企业债务融资工具承销业务内部控制制度是指对内控目标与原则、组织实施、风险识别与评估、内控措施、评价等的制度性规定。

四、评价为“完备、基本完备和缺失”的涵义是：

完备：本机构有关文件对相关制度内容均进行了充分、清晰、全面描述，是以有效力形式的文件发布并具有切实可操作性；

基本完备：本机构有关文件对制度主要内容进行了基本性描述，是以有效力形式的文件发布并具有一定可操作性；

缺失：缺乏两项或两项以上主要内容。