

附件 2:

中国银行间市场交易商协会外资银行类会员 参与 A 类主承销业务市场评价相关材料说明

一、材料内容

(一) 参与市场评价说明书

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

(1) 历史沿革。以主要实体的承继关系为主线,介绍本机构设立、经历的改制重组、重大增减资、合并、分立、更名等代表机构阶段性进程的重要事件,并说明历次股权变更的合规性。

(2) 公司治理结构。包括: a. 股权结构图,主要股东¹基本情况及持股比例,控股股东和实际控制人(主要股东应当逐层说明其股权结构直至实际控制人、最终受益人,以及其与其他股东的关联关系或者一致行动关系),以及股东资质、股权获得、资金来源等方面是否符合《商业银行股权管理暂行办法》等有关规定; b. 组织架构图,股东大会、董事会、监事会、高级管理层、专业委员会的设立及人员组成情况,公司章程中对“三会一层”职责的规定。

(3) 公司治理机制。包括: a. “三会一层”的议事规则、

¹根据《商业银行股权管理暂行办法》(中国银行业监督管理委员会令 2018 年第 1 号)第九条,商业银行主要股东是指持有或控制商业银行百分之五以上股份或表决权,或持有资本总额或股份总额不足百分之五但对商业银行经营管理有重大影响的股东。前款中的“重大影响”,包括但不限于向商业银行派驻董事、监事或高级管理人员,通过协议或其他方式影响商业银行的财务和经营管理决策以及银监会或其派出机构认定的其他情形。

决策程序运行情况,人员履行职责情况;b.近三年监管评级情况,近三年内公司及董事、监事、高级管理人员是否存在违法违规行为,近三年内主要股东是否存在干预经营、通过关联交易进行利益输送、违规质押商业银行股权等违法违规行为,若存在违法违规行为,应说明违法违规事实和受到处罚的情况²。

注:评价标准中公司治理指标评价说明详见附1。

(4)主要监管指标情况。包括:资本充足率等反映资本充足程度的指标,拨备覆盖率等反映贷款损失准备充足性的指标,以及其他反映风险抵补能力的监管指标。

(5)基本业务运行情况。

(6)《营业执照》及《金融许可证》变更情况。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. 所在集团基本情况介绍

包括:基本业务运营情况,所在集团近三年的国际信用评级,全球分支机构设置情况,全球债券承销业务框架及业务开展情况,违法和重大违规情况。

另附:所在集团分支机构名录(模板见附2)、所在集团近三年主承销债券发行明细表(模板见附3)。

3. 部门设置情况说明

说明债券承销业务相关部门的成立时间、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

²请以表格形式列明公司及董事、监事、高级管理人员因违法违规受行政处罚情况(包括:行政处罚决定书文号、事由以及处罚措施),主要股东因干预经营、利益输送、违规质押商业银行股权等违法违规行为受到行政处罚情况。

本机构的地位和作用等情况，并说明从事债券承销业务的部门设置为独立部门、专职团队或兼职团队。

另附：从事债券承销业务相关人员汇总表（模板见附 4）、从事债券承销业务相关人员工作简历（模板见附 5）。

4. 制度建设情况说明

债券承销业务相关制度建设情况说明，包括：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；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；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。

5. 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主承销及承销业务开展的情况（发行金额、只数等）；

（2）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）；

（3）为境外发行人提供金融服务的情况，具体为熊猫债项目提供的服务种类及所担任的角色和职责；

（4）引进境外投资资金情况；

（5）参与协会创新业务及研究的具体情况。

另附：上一年度非金融企业债务融资工具承销发行明细表（模板见附 6）、上一年度为境外发行人提供金融服务项目表（模板见附 7）、上一年度引进境外投资资金情况指标说明（详见附 8）、市场评价基本信息表（模板见附 9）。

6. 本机构最近三年无违法和重大违规行为的说明。

（二）上一年度本机构及所在集团经审计的财务报告复印件

（三）相关证明材料

包括银行间债券市场债券交割量及托管量、非金融企业债务融资工具交割量及托管量、代理境外机构结算量、债券通托管量等证明材料原件。

（四）非金融企业债务融资工具承销业务操作规程

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机构正式发布实施的制度，具体要求详见附 10。

（五）非金融企业债务融资工具承销业务风险管理制度

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机构正式发布实施的制度，具体要求详见附 10。

（六）非金融企业债务融资工具承销业务内部控制制度

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机构正式发布实施的制度，具体要求详见附 10。

（七）集团对参评机构开展非金融企业债务融资工具业务支持函

支持函具体要求详见附 11。

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外资银行类会员参与 A 类主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）与纸质版材料一并提交到交易商协会秘书处。

（一）电子材料

1. 审计报告电子版可只提供资产负债表、利润表及现金流量表。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“XXX（机构）参与市场评价材料”。

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“XXX（机构）材料一：参与 A 类主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. 公司治理指标评价说明
2. 所在集团分支机构名录
3. 所在集团近三年主承销债券发行明细表
4. XX 银行从事债券承销业务相关人员汇总表
5. XX 银行从事债券承销业务相关人员工作简历
6. XX 银行上一年度非金融企业债务融资工具承销发行明细表
7. XX 银行上一年度为境外发行人提供金融服务项目表
8. 上一年度引进境外投资资金情况指标说明
9. 市场评价基本信息表
10. 非金融企业债务融资工具承销业务相关制度及评价指标说明
11. 集团对债务融资工具业务支持情况指标说明

附 1:

公司治理指标评价说明

一、公司治理结构

公司治理结构是指公司建立了以股东大会、董事会、监事会及高级管理层为主体的组织架构。评价为“完善、较为完善和不完善”的涵义如下。

完善：按照《公司法》和《商业银行公司治理指引》等有关规定设立三会一层组织架构，各治理主体职责边界清晰，符合独立运作、有效制衡原则，且下设必要的专业委员会；股权结构清晰透明，股东资质、股权获得及资金来源等方面符合《商业银行股权管理暂行办法》等有关规定。

较为完善：按照《公司法》和《商业银行公司治理指引》等有关规定设立三会一层组织架构，各治理主体职责边界较为清晰，基本符合独立运作、有效制衡原则，且下设必要的专业委员会；股权结构清晰透明，股东资质、股权获得及资金来源等方面符合《商业银行股权管理暂行办法》等有关规定。

不完善：公司治理结构存在缺陷，各治理主体职责不清晰；股权结构不清晰，股东资质、股权获得及资金来源等方面不符合《商业银行股权管理暂行办法》等有关规定。

二、公司治理机制

公司治理机制是指公司股东大会、董事会、监事会及高级管理层制定了完备规范的议事规则、决策程序等机制。评价为“完善、较为完善和不完善”的涵义是如下。

完善：各治理主体建立了完备规范的议事规则、决策程序等机制，并得到有效执行，公司能够合规、良好运营。

较为完善：各治理主体建立了较为完备规范的议事规则、决策程序等机制，并得到较为有效执行，公司基本能够合规运营。

不完善：各治理主体的议事规则、决策程序等机制存在缺陷或未有效执行，公司案件频发；董事、监事、高级管理人员近三年在职责范围内发生重大经济或刑事案件；主要股东近三年内存在干预经营、通过关联交易进行利益输送、违规质押商业银行股权等违法违规行为。

附 2:

所在集团分支机构名录

序号	分支机构所在国家或地区	分支机构名称

填表说明:

1. 每个国家或地区只需列举一家级别最高的分支机构。
2. 可填写英文，按照国家、地区名称首字母排序。

附 3:

所在集团近三年主承销债券发行明细表-XX 年

序号	发行人名称	发行人国家/地区	发行只数	累计主承销金额 (亿美元)

填表说明:

1. 请按年度分别填写本表格（每年度填写一张，共三张）。
2. 发行人名称、国家/地区栏目请填写全称（可英语）。
3. 主承销金额单位为亿美元，保留小数点后两位。

附 4:

XX 银行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经历一致，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，有无取得相关资格证书等。
6. 按照 EXCEL 格式编写本表。

附 5:

XX 银行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 6:

XX 银行上一年度非金融企业债务融资工具承销发行明细表

序号	债券简称	发行人名称	债券品种	发行金额（亿元）	起息日	主承销商	承销金额
承销金额合计:							
承销只数合计:							

填表说明:

1. 请在本表格中填写 2018 年度非金融企业债务融资工具承销业务开展情况。2018 年度获得非金融企业债务融资工具承销商资格的, 请填写自获得资格之日起一年内参与本业务的情况。
2. 承销发行金额从债券起息日开始统计。
3. 发行人名称请填写机构全称。
4. 发行金额单位亿元, 保留小数点后两位。
5. 请在表中标明承销金额与承销只数合计数。
6. 按照 excel 格式编写本表格。

附 7:

XX 银行上一年度为境外发行人提供金融服务项目表

序号	债券简称	发行人名称	发行人机构 类型	发行金额（亿元）	起息日	主承销商	主承销 金额	本机构角色

填表说明:

1. 主承销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. 发行人机构类型包括主权或政府类机构、金融机构、非金融企业等。
4. 发行金额单位亿元，保留小数点后两位。
5. 主承销金额为本机构如承担主承销商角色时实际主承销的份额，若为其他角色，则该金额不填。
6. 本机构角色填写在项目中本机构担任的角色（包括主承销商、财务顾问）。

附 8:

上一年度引进境外投资资金情况指标说明

一、该指标综合考察参评机构代理境外机构结算量、债券通托管量，在分数计算上采取“孰高”原则，即取两项指标得分的最高值计入总分。

二、评价为“好、较好、一般”的涵义如下。

好：上一年度代理境外机构结算量 ≥ 100 亿元；上一年度债券通托管量 ≥ 50 亿元。

较好：1 元 \leq 上一年度代理境外机构结算量 < 100 亿元；1 元 \leq 上一年度债券通托管量 < 50 亿元。

一般：上一年度代理境外机构结算量=0；上一年度债券通托管量=0。

附 9:

评价基本信息表					
机构名称 (全称):					
近三年所在集团债券主承销金额 (亿元)	2016 年		近三年监管评级情况	2016 年	
	2017 年			2017 年	
	2018 年			2018 年	
是否为全球系统重要性银行	上一年度	<input type="checkbox"/> 是 <input type="checkbox"/> 否	总资产 (亿元)	上一年度	
净资产 (亿元)	上一年度		所在集团总资产 (亿美元)	上一年度	
所在集团分支机构覆盖国家或地区数量	2018 年末		所在集团主承销债券发行人数量	上一年度	
非金融企业债务融资工具承销金额 (亿元)	上一年度		非金融企业债务融资工具承销只数	上一年度	
银行间债券市场债券交割量 (亿元)	上一年度		非金融企业债务融资工具交割量 (亿元)	上一年度	
银行间债券市场债券托管量 (亿元)	2018 年 1 月 1 日		非金融企业债务融资工具托管量 (亿元)	2018 年 1 月 1 日	
	2018 年 6 月 30 日			2018 年 6 月 30 日	
	2018 年 12 月 31 日			2018 年 12 月 31 日	
债券通托管量 (亿元)	2018 年 1 月 1 日		代理境外机构结算量 (亿元)	上一年度	
	2018 年 6 月 30 日				
	2018 年 12 月 31 日				
政策性金融债承销团资格	国家开发银行	<input type="checkbox"/> 是 <input type="checkbox"/> 否	人民银行公开市场一级交易商资格	<input type="checkbox"/> 是 <input type="checkbox"/> 否	
	进出口银行	<input type="checkbox"/> 是 <input type="checkbox"/> 否			
	农业发展银行	<input type="checkbox"/> 是 <input type="checkbox"/> 否			
信用风险缓释工具核心交易商资格	<input type="checkbox"/> 是 <input type="checkbox"/> 否		银行间债券市场做市业务资格	做市商	<input type="checkbox"/> 是 <input type="checkbox"/> 否
				尝试做市机构	<input type="checkbox"/> 是 <input type="checkbox"/> 否
从事债券承销业务人员数量			债券承销经验业务人员平均从业年限		
上一年度为境外发行人提供金融服务次数					
经办人:					
单位盖章:					
时间:					

填表说明:

1. 总资产、净资产、集团总资产数据应与上一年度审计报告一致。单位: 亿元(集团总资产为亿美元), 保留小数点后两位。

2. 非金融企业债务融资工具承销金额和只数指与主承销商签署《承销团协议》, 实际承销发行的非金融企业债务融资工具金额和只数, 与《上一年度非金融企业债务融资工具承销发行明细表》保持一致。

3. 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。非金融企业债务融资工具交割量要求同上。

4. 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。非金融企业债务融资工具托管量要求同上。

5. 代理境外机构结算量指接受境外机构委托, 代理其在银行间市场进行的债券交易结算量, 本数据以参评机构为境外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。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。

6. 债券通托管量指本机构所在集团通过债券通投资及其他机构通过所在集团托管的银行间债券市场债券托管量, **本数据以本机构在相关登记托管机构系统中的数据为准**。单位: 亿元, 保留小数点后两位。

7. 从事债券承销业务人员数量指本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 10:

非金融企业债务融资工具承销业务相关制度 及评价指标说明

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”的涵义是如下。

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, 尤其是后续管理方面建立了完备的工作机制和相关制度, 设立了专门机构或岗位从事债务融资工具后续管理工作;

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。

附 11:

集团对债务融资工具业务支持情况指标说明

一、外资银行所在集团对其开展债务融资工具主承销业务出具支持函。支持函内容包括:

1. 支持函由集团出具。支持函需加盖集团公章,或由有权签字人签署(需提供相关授权文件)。

2. 承诺对债务融资工具主承销业务各个环节提供支持,并有相关安排(特别是集团履行后续管理义务方面)。

3. 承诺将支持、督促其在华子行接受协会自律管理、遵守相关自律规则,合规开展债务融资工具主承销业务。

4. 相关支持及承诺以长期有效的形式予以支持。

二、评价为“积极支持、较为支持和一般”的涵义如下。

积极支持:

1. 支持函加盖集团公章或有权签字人为集团总部高级管理人员,且具备协调集团全球资源的能力,能够为参评机构开展债务融资工具业务提供一切所需支持。

2. 集团明确承诺将支持参评机构开展债务融资工具主承销业务,且有详细的支持计划安排。在后续管理方面,集团就履行后续管理职责有明确可操作的安排。

3. 集团承诺将支持、督促参评机构接受协会自律管理、遵守相关自律规则、合规开展债务融资工具主承销业务。

4. 集团就相关安排及承诺有长期明确、可操作的支持计划。

较为支持:

1. 支持函加盖集团公章或有权签字人为集团总部高级管理人员,且具备协调集团全球资源的能力,能够为参评机构开展债务融资工具业务提供一切所需支持。

2. 集团总体承诺将长期支持参评机构开展债务融资工具主承销业务。在后续管理方面,所在集团就履行后续管理职责有基本安排。

3. 集团承诺将支持、督促参评机构接受协会自律管理、遵守相关自律规则、合规开展债务融资工具主承销业务。

4. 集团就相关承诺及安排有长期的支持计划。

一般:

缺乏一项或一项以上主要内容。