

中国银行间市场交易商协会文件

中市协发〔2021〕55号

关于信用风险缓释工具试点业务相关备案事项的通知（2021年版）

各市场参与者：

为加强信用风险缓释工具试点业务自律管理，促进试点业务规范发展，根据《银行间市场信用风险缓释工具试点业务规则》及相关产品指引，现就试点业务相关备案事项通知如下：

一、开展自营投资管理业务的金融机构备案成为核心交易商或一般交易商应符合如下要求：

- （一）符合国家金融管理部门的业务资质要求；
- （二）配备从事信用风险缓释工具的专业人员；
- （三）建立信用风险缓释工具内部操作规程和风险管理制度；
- （四）最近2年没有违法和重大违规行为；
- （五）金融机构如备案成为核心交易商，应建立并不断完善信用风险缓释工具交易定价机制。

二、开展资产管理业务的管理人备案成为一般交易商应符合如下要求：

- (一) 资产管理产品符合投资协议约定的投资范围;
- (二) 配备从事信用风险缓释工具的专业人员;
- (三) 建立信用风险缓释工具内部操作规程和风险管理制度;
- (四) 最近 2 年没有违法和重大违规行为。

三、开展自营投资管理业务的非金融机构备案成为一般交易商应符合如下要求:

- (一) 配备从事信用风险缓释工具的专业人员;
- (二) 建立信用风险缓释工具内部操作规程和风险管理制度;
- (三) 最近 2 年没有违法和重大违规行为。

四、核心交易商备案成为信用风险缓释凭证创设机构(以下简称凭证创设机构)应符合如下要求:

- (一) 净资产不少于 40 亿元人民币;
- (二) 具有从事信用风险缓释凭证业务的专业人员,并配备必要的业务系统和信息系统;
- (三) 建立完备的信用风险缓释凭证创设内部操作规程和业务管理制度;
- (四) 具有较强的信用风险管理和评估能力,有丰富的信用风险管理经验,并配备 5 名以上(含 5 名)的风险管理人员。

五、核心交易商备案成为信用联结票据创设机构(以下简称票据创设机构)应符合如下要求:

- (一) 净资产不少于 40 亿元人民币;
- (二) 具有从事信用联结票据业务的专业人员,并配备必要的业务系统和信息系统;
- (三) 建立完备的信用联结票据创设内部操作规程和业务管

理制度；

（四）具有较强的信用风险管理和评估能力，有丰富的信用风险管理经验，并配备 5 名以上（含 5 名）的风险管理人员。

六、符合上述要求的信用风险缓释工具业务参与者（以下简称参与者）应接受中国银行间市场交易商协会（以下简称交易商协会）的自律管理，并按照附件 1 的具体要求向交易商协会秘书处提交备案材料。核心交易商、凭证创设机构和票据创设机构的相关备案材料经交易商协会金融衍生品专业委员会审议通过后，可开展相关业务；作为一般交易商的市场参与者应在首次开展信用风险缓释工具业务后 30 个自然日内向交易商协会秘书处提交相关备案材料。

七、核心交易商在与一般交易商开展交易前，应充分评估交易对手方风险，做好交易对手方风险管理，并于交易达成后的次一工作日 12:00 前，将信用风险缓释工具交易信息如实通过信用风险缓释工具交易备案及信息服务系统备案。其中核心交易商间的交易由信用保护卖方填录，信用保护买方确认；核心交易商与一般交易商间的交易由核心交易商填录并确认。

八、参与者应确保备案信息的真实、准确、完整，指定专人负责相关备案工作，并将《机构联系人信息表》（附件 2）以电子邮件的方式发送至交易备案邮箱。参与者备案信息发生变更的，应及时与交易商协会秘书处联系。

九、本通知自公布之日起执行。《关于信用风险缓释工具试点业务相关备案事项的通知》（中市协发〔2016〕135 号）、《关于信用风险缓释工具一般交易商备案有关事项的通知》（中市协

发〔2018〕119号)同时废止。

特此通知。

备案联系电话: 010-66538367 010-66539205 010-66539143

传真: 010-66539028

交易备案邮箱: crmti@nafmii.org.cn

附件: 1. 信用风险缓释工具备案材料具体要求

2. 机构联系人信息表

中国银行间市场交易商协会

2021年4月15日