附件2：

**信用风险缓释工具核心交易商/**

**信用风险缓释凭证创设机构/**

**信用联结票据创设机构**

**备案申请表**

|  |  |  |  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- |
| **机构基本信息** | | | | | | | | |
| 机构全称 | | |  | | | 机构简称 |  | |
| 注册地（精确到地市级） | | |  | | | 最近一个会计年度净资产（亿元） |  | |
| 统一社会信用代码 | | |  | | | 法定代表人 |  | |
| 机构类型 | | | □开发性政策性银行 □国有大型银行 □股份制银行 □城商行 □农商行  □外资法人银行 □其他银行业金融机构 □证券公司 □保险公司  □专业从事信用增进业务的机构□其他（请注明）： | | | | | |
| 通讯地址  （同营业执照） | | |  | | | | | |
| **信用风险缓释工具业务基本信息** | | | | | | | | |
| 备案意向  （可多选） | | | □信用风险缓释工具（CRM）核心交易商  □信用风险缓释凭证（CRMW）创设机构  □信用联结票据（CLN）创设机构  注：备案机构在核心交易商基础上才能备案成为创设机构，但可以同时申请。 | | | | | |
| 信用风险缓释工具业务牵头部门 | | |  | | | 最近1年CRM交易名义本金（亿元） |  | |
| 业务负责人 | | | 姓名 |  | 部门及职务 |  | 座机 |  |
| E-mail |  | | | 手机 |  |
| 业务联系人1 | | | 姓名 |  | 部门及职务 |  | 座机 |  |
| E-mail |  | | | 手机 |  |
| 业务联系人2（若有） | | | 姓名 |  | 部门及职务 |  | 座机 |  |
| E-mail |  | | | 手机 |  |
| **信用风险缓释工具业务相关情况说明** | | | | | | | | |
| 1 | 业务资质情况  （必填） | *备案核心交易商或信用联结票据创设机构的，商业银行应具备国家金融监督管理总局或其派出机构批复的衍生产品交易业务资格（若开展信用风险缓释工具业务仅为买入信用保护，则基础类或普通类衍生产品交易业务资格均可），证券公司应提供国务院证券监督管理机构或其派出机构对信用衍生品业务批复的监管意见；信用增进机构应具备相关主管部门批准开展信用衍生品业务的证明文件；*  *备案信用风险缓释凭证创设机构的，商业银行应具备**国家金融监督管理总局或其派出机构批复的普通类衍生产品交易业务资格；证券公司应提供国务院证券监督管理机构或其派出机构对信用衍生品卖出业务批复的监管意见；信用增进机构应具备主管部门批准开展信用衍生品业务的证明文件。*  *注：上述要求将根据监管政策变化予以调整。* | | | | | | |
| 2 | 相关部门和岗位情况简介（必填） | *包括但不限于信用风险缓释工具业务授权体系和相关部门设置（投资、交易、创设、信评、风险管理、法律合规、运营等）情况，并概述自身信用风险缓释工具业务展业流程和信用风险管理流程。* | | | | | | |
| 3 | 从业人员情况（必填） | *信用风险缓释工具业务团队整体情况，以及从业人员从业经验和业务资格能力的情况（具体至个人）。备案信用风险缓释凭证/信用联结票据创设机构的，应配备5名（含）以上的风险管理人员。* | | | | | | |
| 4 | 内部管理制度（必填） | *开展信用风险缓释工具业务适用的内部操作规程和风险管理制度等制度名称列表。相关制度内容应至少包括业务授权与分工、交易执行与管理、风险测算与监控、信用事件触发后的处置、风险报告和内部审计等内容。同时备案核心交易商、创设机构的，上述制度可以合并。* | | | | | | |
| 5 | 合规情况说明（必填） | *最近2年是否存在因人民币债券交易、银行间市场利率或信用衍生品交易的违法违规行为（核心交易商适用），或因人民币债券承销或交易、银行间市场利率或信用衍生品交易的违法违规行为（创设机构适用），受到金融管理部门或其派出机构的行政处罚或交易商协会严重警告、公开谴责的自律处分。* | | | | | | |
| 6 | 银行间市场展业情况（必填） | *最近2年本机构在银行间市场的相关业务情况说明，包括但不限于债券、信用风险缓释工具及其他金融衍生产品业务的交易品种、交易规模等情况。* | | | | | | |
| 7 | 定价估值能力  （必填） | *拟开展信用风险缓释工具相关业务的定价估值能力的说明，包括但不限于开展信用风险缓释工具业务的定价方法、定价人员和相关定价管理机制，以及其他能够反映自身定价能力的相关情况。* | | | | | | |
| 8 | 业务系统情况  （必填） | *开展信用风险缓释工具业务相关的业务系统、风控系统等。* | | | | | | |
| 9 | 其他  （选填） | *其他需说明的内容。* | | | | | | |
| 10 | 证明材料（请后附，并加盖单位公章） | * + 《营业执照》副本复印件；   + 《金融许可证》副本复印件（金融机构适用）或公司章程（信用增进机构适用）；   + 金融管理部门批准开展信用衍生产品业务的相关证明文件（金融机构适用）或主管部门批准开展信用衍生品业务的证明文件（信用增进机构适用）；   + 信用风险缓释工具业务/信用风险缓释凭证创设/信用联结票据创设适用的内部操作规程和风险管理制度；   + 证明上一年末净资产规模的相关文件（备案信用风险缓释凭证/信用联结票据创设机构适用，净资产应不少于40亿元）   + 其他说明涉及的相关材料（如有）： | | | | | | |
| **本机构承诺本表格中填写的内容以及附带的相关证明材料表述真实、准确、完整。**  **本机构承诺遵守中国银行间市场交易商协会相关自律规则，接受中国银行间市场交易商协会的自律管理。**  机构盖章：  日期： | | | | | | | | |

**声明与提示：**

1. 本表格与相关证明材料应加盖机构公章，寄送至：北京市西城区月坛南街1号院6号楼17层中国银行间市场交易商协会交易规范部 邮编100045，电话：010-66539143。本表格及证明材料电子版请发送至邮箱crmti@nafmii.org.cn。
2. 备案完成后，交易商协会将在官网公示相关名单，请及时关注。
3. 机构相关信息如发生重大变化，应及时向交易商协会更新本表及相关证明材料。
4. 交易商协会根据监管要求和信用风险缓释工具业务发展，适时对表格内容进行更新。