

关于做好 2020 年上半年度信用风险管理报告报送工作有关事项的通知

各市场参与人：

为进一步加强资产支持证券存续期信用风险管理，现就做好 2020 年上半年度资产支持证券信用风险管理报告报送工作有关事项通知如下：

一、各市场参与人应当按照《机构间私募产品报价与服务系统资产支持证券存续期信用风险管理指引（试行）》（以下简称《指引》）要求，结合资产支持证券信用风险管理工作中反映出的问题，切实做好风险监测、排查、预警及化解处置等风险管理工作，积极履行信用风险管理义务和相应报告义务。

二、各管理人应于 2020 年 5 月 31 日前报送 2020 年上半年度资产支持证券信用风险管理报告（以下简称本次报告）。

三、本次报告报送的资产支持证券范围为截至 2020 年 4 月 30 日在报价系统挂牌的资产支持证券。

四、本次报告编制过程中，各管理人应当以风险为导向，开展全面深入的风险监测及跟踪处置，避免出现逾期

报送、漏报、错报。各管理人应结合 2019 年度定期报告编制情况，组织对专项计划信用风险状况及程度进行排查，及时调整专项计划风险分类，做到切实履职、勤勉尽责；存在风险分类调整的，应及时向报价系统提交资产支持证券信用风险管理临时报告，并按照规定和约定履行信息披露义务。资信评级机构应结合定期报告内容和风险排查工作，视情况出具不定期跟踪评级报告。

五、半年度信用风险管理报告中应当重点说明违约类、风险类、关注类资产支持证券及报告期内风险分类发生重大不利变化资产支持证券的风险事项、分类依据及风险管理工作开展情况。本次报告中风险分类如为初步分类，管理人应当按照《指引》规定，及时开展风险排查和确定正式分类，并按规定履行信息披露、报告等义务。风险分类如为风险类、违约类的，管理人应当严格按照《指引》规定及时提交资产支持证券信用风险管理临时报告及资产支持证券信用风险化解和处置预案，持续报告资产支持证券的风险状况、已采取或拟采取的风险化解处置及投资者权益保护措施等信息。

六、本次报告通过邮件方式报送，报告盖章扫描后发送至报价系统 abs@sac.net.cn 邮箱。参与人在贯彻落实《指引》过程中，若有任何疑问，可通过以下方式与报

价系统联系：abs@sac.net.cn；010-83897959/13161000950。

七、本次报告报送如存在报送不及时或漏报、错报，或发现管理人在资产支持证券信用风险排查或推进化解处置中未按规定履行相应信用风险管理义务的，报价系统将根据《指引》及相关业务规则规定，视情况采取自律监管措施或实施纪律处分。

特此通知。

中证机构间报价系统股份有限公司

2020年4月10日