关于伦敦分行金融市场部2021年度

金融市场业务转授权和风险限额分配的通知

2021年第1版

|  |  |  |
| --- | --- | --- |
| **版本说明** | | |
| **编号** | **版本** | **修订内容** |
| 1 | 2021年第1版 | * 创建。 |

关于伦敦分行金融市场部2021年度金融市场业务转授权和风险限额分配的通知

一、转授权

（一）业务准入

1.交易业务

（1）外币利率交易业务

| **产品准入** | |
| --- | --- |
| 代客外币利率衍生产品平盘业务 | * 利率互换，币种限于美元、欧元、日元、港币、英镑与离岸人民币 |

（2）汇率交易业务

|  |  |
| --- | --- |
| **通用产品准入** | |
| * 外汇即期、远期、掉期 | |
| **业务单元** | **特定产品准入** |
| 结售汇 | 离岸人民币即期、远期、掉期 |
| 外汇买卖 | - |
| 货币掉期 | 货币掉期（含离岸人民币货币掉期）（管理要求1.1） |

2.人民币债券投资业务

| **产品准入** |
| --- |
| * 国债、地方政府债券、央行票据、政策性金融债 * 金融债、同业存单 * 短期融资券、中期票据、企业债、公司债、非公开定向债务融资工具、大额可转让存单 * 利率互换、远期利率协议 |

3.外币债券投资业务

|  |
| --- |
| **产品准入** |
| * 国债、政府支持机构债（可附带期权）、国际多边机构债（可附带期权） * 商业票据、同业存单、公司债（可附带期权、管理要求1.2） * 远期利率协议、利率互换、货币掉期 |

4.外币司库业务

| **产品准入** |
| --- |
| * 资金拆借内部交易 * 授信范围内的同业拆借、外汇即、远、掉期 * 债券回购、期限1年以内美国国债投资、CD/商业票据投资、短期公司债券、英国国债、德国国债 * 外币同业存单发行 * 远期利率协议、利率互换、交叉货币掉期 |

（二）业务管理要求

1.1人民币对外币货币掉期交易（不包含政策性交易），采用背对背方式或拆分为人民币兑外币外汇掉期+人民币利率互换交易+外币利率互换交易方式进行平盘。

1.2投资次级类公司债需单独审批。

二、风险限额

（一）交易业务

* 利率交易业务

1.代客外币利率衍生品平盘业务

|  |  |  |
| --- | --- | --- |
| **伦敦分行分管行领导** | | **伦敦分行金融市场部负责人** |
| **分行行长级** | **分行副行长级** |
| 许金雷 | 赵钢 | Richard Thaiss |
| * 一年期以上未平盘敞口≤190万美元 * PVBP≤1.9万美元 * 月度损失预警≤9.5万美元 | * 一年期以上未平盘敞口≤190万美元 * PVBP≤1.9万美元 * 月度损失预警≤9.5万美元 | * 一年期以上未平盘敞口≤160万美元 * PVBP≤1.6万美元 * 月度损失预警≤8万美元 |

* 外汇交易业务

2.即远掉期业务限额

|  |  |  |
| --- | --- | --- |
| **伦敦分行分管行领导** | | **伦敦分行金融市场部负责人** |
| **分行行长级** | **分行副行长级** |
| 许金雷 | 赵钢 | Richard Thaiss |
| * 外汇敞口≤475万美元，其中非美元敞口≤190万美元 * 期限≤5年 * 单边PVBP≤4.75万元 * 月度损失预警≤142.5万元 | * 外汇敞口≤475万美元，其中非美元敞口≤190万美元 * 期限≤5年 * 单边PVBP≤4.75万元 * 月度损失预警≤142.5万元 | * 外汇敞口≤400万美元，其中非美元敞口≤160万美元 * 期限≤5年 * 单边PVBP≤4万元 * 月度损失预警≤120万元 |

3.跨境外汇价差交易[[1]](#footnote-1)

|  |  |  |
| --- | --- | --- |
| **伦敦分行分管行领导** | | **伦敦分行金融市场部负责人** |
| **分行行长级** | **分行副行长级** |
| 许金雷 | 赵钢 | Richard Thaiss |
| * 单边外汇敞口≤2.85亿美元 * 年度损失预警≤2850万元 * 期限≤3年 | * 单边外汇敞口≤2.85亿美元 * 年度损失预警≤2850万元 * 期限≤3年 | * 单边外汇敞口≤2.4亿美元 * 年度损失预警≤2400万元 * 期限≤3年 |

注：限额与总行金融市场部合并计算。

（二）人民币债券投资业务

|  |
| --- |
| * FVOCI类债券久期≤4.2年 * 综合久期≤4年 * 人民币信用债占比≤30% * 人民币信用债AA级及以下（含无评级）占比≤5%   *上述限额和总行金融市场部合并计算*   * 规模≤1.5亿美元（与外币信用债券投资规模合并计算） * 单个信用债发行人投资规模超过1000万美元，需提交总行金融市场部审批 * 非公开融资工具限额 * 债券发行人评级不低于AA+ * 规模≤1亿元（与总行合计规模≤500亿元） * 期限≤5年 * 单期余额占发行额比例≤50%，对于我行主承销债券，该比例不得高于20% |

（三）外币债券投资业务

|  |
| --- |
| * FVOCI类债券久期≤2.5年 * 综合久期≤2.5年 * 平均评级≥BBB-[[2]](#footnote-2) * 外币信用债BB及以下（含无评级）≤5% * 单只信用债（不含私募债、结构化债券和CD，与外币债券交易业务合并计算）持有规模占发行量的比例≤30% * 出具维好协议的债券规模占外币债券投资余额的比例≤20%   *上述限额与总行金融市场部合并计算*   * 外币信用债券投资规模≤1.5亿美元 * 单个信用债发行人投资规模超过1000万美元，需提交总行金融市场部审批 |

（四）外币司库业务

外币短期债券投资业务限额与外币债券投资业务合并计算。

三、管理要求

（一）你分行金融市场部须在转授权范围内开展业务，准入开展的业务应制定完备的管理制度，明确业务管理机制、操作规程、相关风险的控制措施等，严控各类风险。

（二）你分行金融市场部业务各级被授权人和风险限额执行人须严格执行转授权和风险限额，严禁超准入范围和超限额开展业务。

（三）对于涉及与总行金融市场部相关使用处室合并计算的风险限额，你分行金融市场部应持续关注指标值变动，当指标值达到预警线水平时，应与总行金融市场部限额共用处室及时协商,共同将指标值控制在合理水平。

（四）你分行金融市场部如需进行转授权和风险限额调整，须遵照中信银行金融市场条线转授权和风险限额相关管理办法执行。

（五）如出现被授权人和风险限额执行人出差、休假等原因短期不在岗的情况，你分行金融市场部应及时办理转授权和风险限额临时调整事宜，并妥善保存相关转授权文档备查。

（六）如出现新增、停用投资组合或变更组合经理权限和限额的情况，你分行金融市场部应及时申请转授权调整。

你分行金融市场部相关业务转授权和风险限额事宜本通知未予明确的，以总行最新规定为准。

本通知相关转授权和风险限额分配自总行金融市场部部门负责人签发之日起生效，有效期至2022年度新转授权和风险限额分配通知签发日之前一日。

附件：资产组合及组合经理列表

附件：资产组合及组合经理列表

|  |  |  |
| --- | --- | --- |
| **账户** | **资产组合** | **组合经理** |
| **交易账户** | LDFX 外汇即期、远掉期交易 | Richard Thaiss,王任君，刘渤洋、梁垚 |
| LTRD 外汇货币掉期、利率掉期交易 | Richard Thaiss,王任君，刘渤洋、梁垚 |
| LTSY 司库外汇交易 | Richard Thaiss,王任君，刘渤洋、梁垚 |
| **银行账户** | LDMM 流动性管理 | Richard Thaiss,王任君，刘渤洋、梁垚 |
| LLIQ 司库债券 | Richard Thaiss,王任君，刘渤洋、梁垚 |
| LINV 外币债券投资 | Richard Thaiss,王任君，刘渤洋、梁垚 |
| LCNV 人民币债券投资 | Richard Thaiss,王任君，刘渤洋、梁垚 |

1. 境内外交易名义本金和期限相同，方向相反，不得持有敞口。 [↑](#footnote-ref-1)
2. 对平均评级、BB及以下评级债券占比指标，不含中信银行集团内部子公司发行人。对于无评级债券，如发行人或担保人、维好人、备用信用证提供人有境内评级，则豁免境内AA+（含）以上评级债券；维好人境内评级AAA以上的金融机构债不适用。 [↑](#footnote-ref-2)