

# 东方金诚信用评级方法模型管理办法

## (RB014201907)

### 第一章 总则

第一条 为提高公司评级方法模型的规范性、科学性、适用性和合规性，保障公司评级质量，根据相关监管和自律规定，结合公司的相关管理制度，特制定本管理办法。

### 第二章 组织与职责

第二条 信用评级委员会（以下简称为“信评委”）是公司评级方法模型的拟定机构，采取联席评审会机制，具体职责如下：

- （一）决定或调整评级方法模型工作组的成员；
- （二）审议和批准评级方法模型工作组的工作计划，并督导工作计划的执行；
- （三）审议评级方法模型工作组提交的评级方法模型定期或不定期执行评估报告；
- （四）审议评级方法模型工作组提交的评级方法模型草案。

第三条 公司技术委员会是公司评级方法模型的批准机构。信用评级委员会联席评审会评审通过的评级方法模型须经技术委员会批准之后方能生效和对外披露。

第四条 信评委设立评级方法模型工作组负责统一管理评级方法模型的开发、解释、应用和修订等工作。

评级方法模型工作组负责人由公司办公会指定，成员由信评委主任和评级方法模型工作组负责人在信评委委员中指定，还可选择具有丰

富经验和数理统计特长的分析师参加评级方法模型工作。

评级方法模型工作组下设协调小组负责评级方法模型统筹工作，同时按照专业分工常设工商小组、公用小组、结构融资小组、金融小组、主权评级小组、创新业务小组等专业小组专责管理相应领域的评级方法模型。各专业小组负责人由相关部门负责技术管理的中层担任。

**第五条** 评级方法模型工作组的主要职责包括：

（一）起草公司评级方法模型制定、修订和相关研究的工作计划，负责执行信评委审议通过的工作计划；

（二）开展新评级方法模型的研究工作，起草评级方法模型；

（三）每年至少实施一次对已有评级方法模型的执行效果的检验和评估，起草评估报告、评级方法模型修订案；

（四）对评级方法模型在应用过程中的问题作出解释；

（五）信评委主任交办的其他工作。

### **第三章 评级方法模型的制定或修订**

**第六条** 评级方法模型的制定和修订分为立项、研发、三级审核、评审、合规审核、批准生效、结项、资料归档环节。

1. 立项是指由评级方法模型工作组负责人对列入信评委审定的工作计划的每一个评级方法模型项目指派项目组长和成员，明确项目进度要求和质量要求。

2. 研发是指项目组对评级方法模型进行比较分析、评级质量检验评估和评级方法模型草案起草。

3. 三级审核是指项目组起草的研究报告、评级方法模型需经项目组长、所在专业小组负责人和评级方法模型组负责人三级审核，由评级方法模型组负责人决定是否提交信评委审议。

4. 评审是指由两个信评委主任共同召开联席评审会对评级方法

模型组提交的评级方法模型研究报告进行审议。

5. 批准生效是指技术委员会对联席评审会审议通过的评级方法模型确定版本号、适用范围、有效期和对外披露日期。

6. 合规审核是指合规审计部对技术委员会批准生效的评级方法模型实施合规审核，对符合合规要求的项目准予办理结项。

7. 结项是指信评委秘书根据合规审核意见对评级方法模型项目办理结项事宜，或者对信评委决定终结的评级方法模型项目办理终结事宜。

8. 资料归档是指对项目组对结项或终结的评级方法模型项目在每一个环节所形成的资料归集整理后形成档案，由信评委秘书参照《东方金诚评级项目档案管理办法》办理存档。

#### 第四章 评级方法模型的发布

第七条 未经技术委员会批准生效和合规审计部合规审核，任何部门和个人不得以任何形式发布、泄漏公司评级方法模型。

第八条 经技术委员会批准生效并经合规审计部合规审核的评级方法模型，由信息披露组负责按照《东方金诚评级业务信息报备与披露事务管理制度》向监管部门和自律机构指定平台实施报备、注册文件更新和披露，需公开披露部分还应在公司官网进行披露。披露的内容包括但不限于版本、制定或修订日期、制定或修订说明、适用业务类别或行业，基本假设及核心要素、定性和定量指标（权重、阈值）、方法模型局限性等。

信息披露组应在监管或自律规定的时间以技术委员会确定的时间内完成报备和披露工作。

对于不再生效的评级方法模型，信息披露组还应在监管部门和自律机构指定平台、公司官网公开说明已经失效。

第九条 对于可公开披露的评级方法模型，经评级方法模型工作组负责人和新闻发言人共同批准，品牌建设部可在合规审计部信息披露组完成报备披露后通过媒体渠道或者公司自媒体渠道发布，或者印制为公司宣传品。

第十条 向监管部门和自律机构、发行人、投资人、中介机构、社会公众等渠道分发的公司评级方法模型资料，或者以书面、口头方式陈述的公司评级方法模型，必须经评级方法模型工作组负责人审核，确保与已公开披露的评级方法模型、正在实际使用的评级方法模型保持一致，且必须在显著位置说明是公司正在使用的评级方法模型。

出于研究目的，研究人员和分析师确需要在对外技术交流涉及公司正在开发中的评级方法模型、已经失效的公司评级方法模型的，需评级方法模型组负责人书面批准。

## 第五章 评级方法模型的应用

第十一条 评级作业部门在每个评级项目中使用的评级方法模型应当是处于有效期且已经公开披露的评级方法模型，并在评级报告显著位置列示评级方法模型的名称、版本号以及评级模型运算结果。

正在开发中的评级方法模型可以用于内部测试，但不能作为评级项目上会资料，不得作为评级依据，也不得列入项目档案。

第十二条 评级方法模型的应用说明是每个评级项目上会的必备资料和评审会决议的组成部分，应当载明信评委对模型假设符合情况判断、适用的评级模型、指标取值、模型参考结果和信评委投票评定的最终结果。

评级方法模型应用说明由评级项目组起草，在上会前应当通过项目组、部门和评级总监（或其授权人）的三级审核。

第十三条 专业小组应当对评级方法模型的运行效果每年至少开展一次评估，在发生重大变化时应启动不定期跟踪评估。

评级作业部门、研究发展部、投资人服务部、营销管理中心等部门也可以向专业小组提出评级方法模型应用反馈意见。

第十四条 评级方法模型工作组可在信评委审议通过的评级方法和模型范围内，对各部门应用评级方法模型方面提出的问题开展书面解释；但书面解释不得对技术委员会批准生效的评级方法模型进行实质性修改。

评级方法模型工作组负责人签发的评级方法模型书面解释，经合规审计部出具书面合规审核意见后视同评级方法模型的一部分，并在评级项目中予以应用。

## 第六章 附 则

第十五条 合规审计部负责对本办法及执行情况实施合规审核。

第十六条 本办法由公司技术委员会审定、解释和修改，由公司办公会批准发布。

第十七条 本办法编码为 RB014201907，自 2019 年 8 月 1 日起生效。

第十八条 本办法的内容覆盖了 DB-2-2 关于评级方法和模型管理的自律要求。