

<<风险管理（第13辑）>>

图书基本信息

书名：<<风险管理（第13辑）>>

13位ISBN编号：9787802558359

10位ISBN编号：7802558352

出版时间：2011-6

出版时间：企业管理出版社

作者：中国金融风险经理论坛组委会 编

页数：180

版权说明：本站所提供下载的PDF图书仅提供预览和简介，请支持正版图书。

更多资源请访问：<http://www.tushu007.com>

<<风险管理（第13辑）>>

内容概要

《风险管理》秉承中国金融风险经理论坛的一贯精神和原则，扩展和延伸风险管理技术交流平台，进一步促进中国金融风险经理之间的交流和现代风险管理理念、制度和技术方法在中国的广泛传播。它的出版无疑对我国金融风险管理的发展产生积极的推动作用。

本书是《风险管理（第13辑）》。

书籍目录

卷首语

巴塞尔协议给力中国银行业发展

专业评论

风险、资本、收益的平衡管理

监管新标准：商业银行风险管理转型升级的新契机

Base 在中国：需考虑的几个问题

解读中国版巴塞尔协议中的资本充足率监管标准及其影响

农村商业银行实施新资本监管标准的工作要点

专题访谈

股份制银行全面风险管理与新资本协议实施——专访上海浦东发展银行穆矢副行长

沙龙研讨

数据管理与风险管理

主题风险

信用风险 中小企业信用风险管理的几点体会

市场风险 市场风险管理对商业银行基础设施建设的基本要求

商业银行代客业务风险管理

操作风险 操作风险管理审核架构

银行建立内部控制与合规风险管理体系的探索与实践

流动性风险 流动性风险、信用风险以及联邦储备委员会应对危机的措施

全面风险 损失基准点在西方商业银行风险管理中的应用

全面风险管理与资产负债管理

全面风险管理实践和挑战

监管与合规 国际金融监管改革最新动态及思考

前沿讲座

压力测试及在证券公司的应用

经典案例

北岩银行危机案例分析

理论研究

公司类风险暴露违约损失率的数据基础和模型建设研究

关于我国建立巨灾保险体系的思考——基于博弈论的分析

商业银行资本监管研究——一个文献综述

风险学苑

风险书评 超越金融：索罗斯的哲学

风险典故 古人“君子重诺守信”的诚信文化

专业英语 英文段落节选

## 章节摘录

计准则时都会遇到一个困难,即由谁、凭什么进行持有目的的划分。一些交易机构直接由交易员在买入时确定放在哪个科目,如何进行核算,令风险管理人员懊恼不已,会计的监督功能丧失殆尽。

那么,持有目的又是由什么决定的呢?

我们认为,会计准则中提到的持有目的应该由交易策略决定,即在交易之前,就应该明确买入一只债券到底是用来投资,还是用来交易(投机赚取价差),或仅仅为了流动性管理的短暂需要,为了达到这一目的,一些银行将这些功能放在不同的部门,由不同的人员进行管理。

随着交易活动的发展,交易策略的种类和复杂程度不断增加,不同市场、不同产品之间的套利交易行为日益频繁,动态对冲行为开始出现,不同产品除事前明确其交易目的外,还需要进行风险因子的匹配,面对这类复杂局面,我们必须引入一个新概念,帮助我们完成持有目的的划分工作,这就是对“组合”的定义。

在一个新的交易策略提出后,风险管理人员应与交易人员一道对交易策略进行研究,明确完成该项交易策略所涉及的产品,并与会计人员一起,明确产品交易后所使用的会计核算方法。

在此基础上,风险管理人员与交易人员共同确定产品定价模型,以及这些产品所涉及的风险因子,包括主要参数来源。

之后,风险管理人员确定风险计量方法,包括敏感性指标和VaR指标的计算,并根据风险计量结果,为该交易策略确定风险限额指标,这些工作完成后,将上面提到的内容写入交易组合定义文件中,供银行上级管理机构进行审批。

这些事前提出的交易策略、产品组合、会计核算方法(包括持有目的分类)、定价模型、模型参数等要素作为交易制度必须严格执行,才能保证市场风险的后续管理。

所以说,将交易策略转变为对交易组合的定义,是一个很好的市场风险识别过程。

同时,交易组合的定义也是市场风险识别的良好载体。

当然针对一项业务的开展所进行的市场风险管理的准备工作还有很多,如定价模型在系统中的开发,交易簿记系统的开发,风险计量模型的系统开发,损益计算模型的开发工作等,都是新的交易策略实施前必须完成的工作,这些工作与交易组合定义一起,组成对新产品(新策略)的事前管理工作,从这个意义上讲,新产品管理也可以叫做新的交易策略管理。

.....

编辑推荐

专题评论：中国银行业实施巴塞尔协议、股份制银行全面风险管理与新资本协议实施、数据管理与风险管理、国际金融监管改革最新动态及思考、压力测试及在证券公司的应用。

版权说明

本站所提供下载的PDF图书仅提供预览和简介，请支持正版图书。

更多资源请访问:<http://www.tushu007.com>