

<<商业银行市场风险限额设置与管理>>

图书基本信息

书名：<<商业银行市场风险限额设置与管理>>

13位ISBN编号：9787302293347

10位ISBN编号：7302293341

出版时间：2012-7

出版时间：清华大学出版社

作者：刘晓曙

页数：146

字数：124000

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>

## <<商业银行市场风险限额设置与管理>>

### 内容概要

从国外先进银行的经验来看，市场风险管理最主要的手段，甚至可以称为唯一的手段是建立风险限额体系、实行限额监控和超限额处理。

限额体系在市场风险管理中发挥风险预警作用和风险实时监控作用。

刘晓曙编写的《商业银行市场风险限额设置与管理》的主要目的是针对我国商业银行实际，研究如何设置风险限额以及如何管理、应用风险限额。

《商业银行市场风险限额设置与管理》的主要出发点并不是打算创新当前即使西方先进银行也不具备的风险管理技术，而是希望在市场风险管理技术的常识基础上，通过整合现有的市场风险管理技术和实践经验，结合我国商业银行的风险管理实践，给出一个清晰的市场风险管理体系和技术框架，期望能为市场风险管理者和银行从业人员提供具有操作手册功能的详细指引，为我国商业银行的市场风险管理提供实质性的指导。

《商业银行市场风险限额设置与管理》的主要读者是商业银行市场风险高级管理人员及大专院校金融学专业研究生与研究人员。

书籍目录

第一章 风险限额设置与管理概述

- 谁来思考和设定风险限额
- 风险限额与风险价值
- 风险限额与银行的市场风险容忍度
- 风险限额与一阶、二阶风险
- 作为谨慎控制交易的限额
- 限额管理与风险分散化
- 风险限额与波动性、流动性

第二章 市场风险限额管理政策

- 第一节 市场风险管理组织架构
- 第二节 市场风险限额体系
  - 一、影响银行风险限额体系设置模式的因素
  - 二、构建市场风险限额体系的两种思路
  - 三、商业银行典型的市场风险限额体系结构
  - 四、多重限额和子限额的使用

第三节 限额的监控与超限额的处理

- 一、超过风险限额的处理
- 二、市场风险限额的报告体系
- 三、风险限额的检测与调整

第三章 限额配置工具与配置过程

第一节 作为限额配置的资产波动方法

- 一、在险价值的界定
- 二、在险价值的计算
- 三、VaR工具
- 四、经流动性风险调整的VaR

第二节 作为限额配置的风险盈利法

- 一、风险盈利模型
- 二、修正的风险盈利模型
- 三、EaR工具

第三节 市场风险限额配置过程

- 一、RAROC工具
- 二、动态的资本 / 限额配置模型

第四节 银行总的市场风险限额和分账户管理的市场风险限额设置

- 一、银行总体的市场风险限额设置
- 二、分账户管理的市场风险限额设置

第四章 交易账户市场风险VaR限额设置与管理

第一节 交易账户市场风险VaR限额的管理

- 一、VaR的时间可加性
- 二、考虑累积损失的VaR限额管理
- 三、VaR限额管理方式

第二节 交易账户市场风险VaR限额的设置

- 一、交易账户VaR限额设置的实务做法
- 二、基于RAROC优化的交易账户市场风险限额设置模型

附录：

第五章 银行账户利率风险限额的设置、管理与应用

## <<商业银行市场风险限额设置与管理>>

### 第一节 市场风险限额的设置

- 一、有效的市场风险限额
- 二、设置市场风险限额的步骤

### 第二节 银行账户利率风险限额的应用

### 第三节 银行账户市场风险限额的技术性管理——基于改善银行风险—回报关系

- 一、加快识别不利利率的逆转趋势
- 二、加快作出减少头寸决定的速度
- 三、加速贯彻实施消减风险头寸的决策

## 第六章 案例：关于××银行的市场风险限额设置与管理方案

- 一、市场风险限额管理政策
- 二、市场风险限额管理方式
- 三、市场风险限额设置

### 参考书目

编辑推荐

《商业银行市场风险限额设置与管理》将围绕如何设置商业银行的市场风险限额以及如何管理、应用风险限额这一主题，从以下几个方面进行论述：第一个问题是，市场风险限额体系通常应具有什么样的结构层次，相应的市场风险管理组织结构怎样，限额管理的授权体系是怎样的，尤其是当限额遭遇突破时如何处理；第二个问题是设置市场风险限额的工具或方法有哪些；第三个问题是分账户管理时市场风险限额是如何配置与管理的。

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>