

中国银行业监督管理委员会关于进一步加强商业银行市场风险管理工作的通知 PDF转换可能丢失图片或格式，建议阅读原文

https://www.100test.com/kao_ti2020/313/2021_2022__E4_B8_AD_E5_9B_BD_E9_93_B6_E8_c80_313146.htm 中国银行业监督管理委员会关于进一步加强商业银行市场风险管理工作的通知（银监发[2006]89号）各银监局，各国有商业银行、股份制商业银行：近年来，商业银行市场风险管理水平虽然有所提高，但仍然存在许多薄弱环节，亟待改善和提高。为有效落实《商业银行市场风险管理指引》的要求，促使商业银行进一步加强市场风险管理工作，现将有关要求通知如下：一、各银行董事会应提高对市场风险管理重要性的认识。董事会或由董事会授权其下设的专门委员会应负责制定全行市场风险管理的战略与相关政策，督促高级管理层具体实施，应至少每半年听取一次全行市场风险管理情况报告。二、各行在总行高级管理层中应配备一名高管人员负责全行的市场风险管理工作，该高管人员原则上应具备五年以上与市场风险管理相关的工作经验。三、各行应结合本行的风险管理架构和特点，指定专门部门统一负责掌控全行总体市场风险状况，并负责向专门委员会和高管层汇报，应将境内外分支机构的市場风险管理纳入统一的市场风险管理中，并建立统一的市场风险管理信息系统。四、各行应使从事市场风险管理的部门及人员与承担风险的业务经营部门及人员完全独立，从事市场风险管理的部门与承担风险的业务经营部门应向不同的高管人员报告工作。五、各行应加强对市场风险管理部的人力资源配罝。从事市场风险管理的部门负责人应具备三年以上与

市场风险管理相关的工作经验，该部门下设的与市场风险管理相关工作相关的团队（或处室）主要负责人应具备二年以上与市场风险管理相关的工作经验。六、各行应建立及时有效的市场风险分析报告机制、重大市场风险应急机制、新产品和新业务中的市场风险管理机制，清晰有效地划分银行账户和交易账户，并建立相应的市场风险识别、计量、监测和控制方法。七、各行应以现有人民币国债和相关产品交易价格为基础，采用国际通用的方法研究并建立基于市场的人民币国债收益率曲线，作为人民币产品定价和风险管理的基础。

100Test 下载频道开通，各类考试题目直接下载。详细请访问
www.100test.com