

大宗商品贸易业务操作主要风控模式及案例分析课纲

为了能够让学员全面掌握与大宗商品贸易业务风险管控相关的知识和实践技能，使得风险管理最终能够在企业中实际应用，切实管控风险、发现机遇，内训课程将分为预备知识和应用两部分。其中预备知识主要为大宗商品贸易业务风险管理应用进行理念、模式、方法和技能的准备，而“大宗商品贸易业务风险管理应用”则针对大宗商品贸易业务中的各类风险点利用基础篇讲授的各种方法实际进行风险控制，为企业经营绩效的获取提供保障以及决策支持。

1. 风险管理基础知识

- 风险及风险管理相关术语
- 风险管理体系
- 风险管理基本逻辑
- 风险管理流程
- 三道防线与风险报告

- 问题与案例—问题：风险管理与其他管理理论的区别；

案例：中国五矿风险管理部门的层级分析

2. 内部控制合规与操作风险管理

- 内部控制概要
- 内部控制框架
- 内部控制体系建设
- 内部控制合规
- 内部控制与风险管理、操作风险管理的关系
- 大宗商品贸易的操作风险管理
- 操作风险识别路径
- 操作风险点识别方法
- 案例分析：基于风险识别的管控流程设计

3. 大宗商品贸易业务风险监管

- 大宗商品贸易业务风险类型
- 监管严格禁止的贸易业务
- 监管严格控制的贸易业务

- 风险监管的典型模式

- 案例：监管缺陷分析

4. 大宗商品贸易业务风险管理框架

- 企业对贸易业务风险监管的机制与体系

- 大宗商品贸易风险管理模型

- 大宗商品贸易业务风险点识别

- 面向交易过程的风险管理信息系统

- 案例：面向过程的操作风险事中监测模式

5. 大宗商品贸易业务操作风险管理

- 大宗商品贸易业务典型流程分类

- 业务流程上的操作风险点分析

- 交易决策操作风险点分析

- 结算业务风险管理

- 仓储运输风险管理

- 关务风险管理

- 贸易合同（欺诈）风险管理

- 操作风险点的监控模式与方法

- 各种欺诈案例分享

6. 大宗商品贸易信用风险管理

- 信用风险的基本概念及管理对象
- 信用调查及信用档案
- 授信管理
- 交易总账户信用风险控制
- 全流程信用风险管理模式
- 示例：信用风险调查工作底稿

7. 大宗商品贸易业务集中度风险管理

- 贸易资产集中度的战略/策略管理概念
- 集中度风险分类
- 贸易资产集中度风险限额管理
- 示例：山东晨曦集团倒闭案

8. 大宗商品贸易业务价格及汇率风险管理

- 价格风险和汇率风险的概念
- 商品价格和汇率风险的表现形式
- 大宗商品贸易的定价模式

- 商品贸易的价格和汇率风险的典型管理方法
- 利用压力测试方法来管理价格和汇率风险
- 示例：应用压力测试或动态模拟方法管理大宗商品贸易的汇率风险

9. 大宗商品贸易资金风险管理

- 贸易公司流动性风险产生的机理
- 贸易公司的负债经营的利弊分析
- 大宗商品贸易企业的流动性风险管理体系
- 流动性风险管理的比例法
- 流动性风险管理的缺口表法
- 流动性风险管理的现金流分析法
- 流动性风险管理的动态模拟法
- 流动性风险管理压力测试应用案例