

# 商业银行流动性风险分析及流动性管理

## 【课程大纲】

- 1 概念篇：何为流动性风险？
  - 1.1 资产负债表观下的“三类流动性”及流动性风险
  - 1.2 “三重资产负债表”框架下流动性的创造与回收
  - 1.3 流动性风险事件与“向险而生”的商业银行第一大风险论断
  - 1.4 小结：我们的流动性源自何处？
- 2 政策篇：我们该如何合规的管理流动性？
  - 2.1 流动性风险管理的理论框架及其实操指导意义剖析
  - 2.2 巴塞尔委员会规则体系内的流动性风险管理指导性框架
  - 2.3 我国商业银行流动性风险管理政策的快速迭代与实践冲击
  - 2.4 小结：流动性风险管理需要的不只是技术工具！
- 3 实操篇：我们该如何测算、分析及管理流动性？
  - 3.1 流动性及其风险的识别与量化方法
  - 3.2 流动性风险评估方法
  - 3.3 流动性风险的压力测试方法及其全流程操作
  - 3.4 流动性风险的日常管理

### 3.5 流动性风险的应急计划设计及其实施

## 4 报告篇：我们该如何回报流动性风险？

### 4.1 季度型流动性风险压力测试报告的逻辑框架与编写方法

### 4.2 流动性风险的量化报告及其作用解析

### 4.3 流动性风险预警体系构建的想法分享