

投資平台 > 產品採購

名稱	制定交易對手的最高交易限額
編號	106814L6
應用範圍	制定交易對手的最高交易限額。適用於為私人銀行客戶而設的不同投資產品的外部供應商的交易活動(如OTC場外衍生工具市場、遠期合約)
級別	6
學分	5 (僅供參考)
能力	<p>表現要求</p> <p>1. 展現管理產品風險的專業知識</p> <p>能夠：</p> <ul style="list-style-type: none"> • 展現風險管理的專業知識以確認、評估及控制私人銀行業務面對的對手風險。 • 全面評估銀行風險管理政策以便按照銀行全盤策略設定政策/指引 <p>2. 設定信用相關對手交易限額</p> <p>能夠：</p> <ul style="list-style-type: none"> • 審慎評估產品供應商及其交易活動，找出可能的風險（如結算前風險、結算風險、違約風險）及風險指標 • 就主要風險處理研究一般業務門檻以設定基線 • 比較不同風險計算的模式，選擇最合適的方法以設定風險限額 • 平衡在不同市場情況下的商機及風險暴露，為各風險措施設定架構以明確制定可承受的風險限額 • 就違規、個別報告及文檔處理定下政策 <p>3. 制定對手評估/審核政策</p> <p>能夠：</p> <ul style="list-style-type: none"> • 為對手制定管控程序及交易限額及如需要，採取適當的風險管理策略(如擔保金協議、保險等) • 評估報告以分析違規/例外情況及採取措施將影響減至最低 • 定期研究限額的架構，重新檢視。如有需要則作出改進
評核指引	<p>此能力單元的綜合成效要求為：</p> <ul style="list-style-type: none"> • 制定交易對手的最高交易限額及相關政策。該等政策需按照銀行信用管理政策及存在風險評估等因素制定。
備註	