



中央财经大学

Central University of Finance and Economics

培训学院

Training School

中央财经大学培训学院财经大讲堂【第三讲】
暨“2012 面对全球金融危机风险管理新趋势”研讨会

主办单位：中央财经大学培训学院

协办单位：国际商业机器股份有限公司（**IBM**）

国际风险管理师大中华认证中心（**GCPRM**）

时间：**2012年12月01日（星期六）18:50-21:30**

地点：中央财经大学（学院南路校区）学术会堂**402**报告厅



中央财经大学

Central University of Finance and Economics

培训学院

Training School

会议议程

时间	活动议程
贵宾致词 18:50-19:00 (10 分钟)	蔡如海 中央财经大学培训学院副院长
19:00-19:40 (40 分钟)	<p style="text-align: center;">主题演讲（一）</p> <p>主持人：吴宗叟博士 GTSM 高级专家、GCPRM 大陆事务部主任</p> <p>嘉宾：黄柏翔 台湾金融工程师学会副秘书长、GCPRM 研发部主任</p> <p>主题：面对全球金融危机流动性风险管理新趋势</p> <ul style="list-style-type: none"> ➢ 银行面对的总体流动性风险-逆循环资本缓冲 (<i>The Threat of Cyclical Liquidity Risk on Banking Industry- Countercyclical Policy and Management Tools</i>) ➢ 流动性风险值 (<i>Liquidity-Adjusted Market Risk Measures</i>) ➢ 日内流动性风险管理 (<i>Intra-Day Liquidity Risk</i>)
19:40-20:20 (40 分钟)	<p style="text-align: center;">主题演讲（二）</p> <p>主持人：刘毅 北京鸿道投资管理有限公司研究总监与风控总监</p> <p>嘉宾：王雪松博士 IBM 风险管理总监顾问</p> <p>主题：利率市场化下的经济资本管理</p> <p>随着国内利率市场化的逐步推进，银行如何在利率市场化的前提下使用经济资本管理的工具对于有限的资本以及流动性资源进行合理配置，并且在交易层面对于业务部门进行管理已经成为风险部门最关注的问题之一。在本讨论中我们将注重讨论经济资本管理的核心目标，同时与大家分享 IBM 公司在协助国内银行进行的经验。</p>
20:20-20:30 (10 分钟)	茶 歇



<p>20:30-21:10 (40 分钟)</p>	<p style="text-align: center;">主题演讲（三）</p> <p>主持人：黄昌利副教授 中央财经大学金融学院</p> <p>嘉宾：李越君总监 CFA、IBM 大中华区风险管理及合规总监</p> <p>主题：实现市场风险和信用风险的全面管理</p> <p>在新资本协议实施以及各银行在风险应用方面的尝试中，我们越来越认识到市场风险和信用风险的相互依赖和全面风险管理的重要性。在本主题讨论中我们将介绍市场风险和信用风险共同关注的问题和实现有效管理的框架以及方法。</p>
<p>21:10-21:30 (20 分钟)</p>	<p style="text-align: center;">互动与交流</p> <p>主持人：蔡如海 中央财经大学培训学院副院长</p> <p>互动嘉宾：</p> <p>王雪松博士 IBM 风险管理总监顾问</p> <p>李越君 CFA、IBM 大中华区风险管理及合规总监</p> <p>黄柏翔 台湾金融工程师学会副秘书长、GCPRM 研发部主任</p> <p>黄昌利博士 中央财经大学金融学院副教授</p> <p>刘毅 北京鸿道投资管理有限公司研究总监与风控总监</p> <p>吴宗叟博士 GTSM 高级专家、GCPRM 大陆事务部主任</p>



中央财经大学

Central University of Finance and Economics

培训学院

Training School

演讲嘉宾简介

李越君 **CFA、IBM** 大中华区风险管理及合规总监

金融业经验：IBM GCG –大中华区风险管理及合规总监；IBM US – 美国风险管理及合规总监；Barclays Capital – 投资组合风险管理总经理，负责结构性产品组合管理，及全北美产品风险管理；Wachovia – 市场风险总经理。负责市场风险交易账户及银行账户的市场风险；Fifth Third Bank – 全面风险管理总经理。负责全行全面风险管理的政策，制度，计量及报告。

研究专长领域：新巴协议 II & III, 市场风险, 信用风险, 流动性风险；资本金融市场, 交易和产品估值, 交易损益, 前、中、后台交易一体化；PD/LGD/EAD, 组合管理及优化, 抵押品管理, 信用及债项评级, 经济资本及应用；金融结构性产品, ABS/MBS/CDO/CDS；资产管理。

王雪松博士 **IBM** 风险管理总监顾问

哈佛大学数学博士，在加入 IBM 之前在美国摩根大通(JPMorgan)银行以及香港汇丰银行风险方法部门工作十余年，负责关于信用风险、经济资本、贷款定价、交易对手风险管理、市场风险模型验证、Basel 参数量化等领域。自 2000 至 2008 王先生负责 JPMorgan 的经济资本模型研发工作。王先生作为咨询顾问为国内银行进行了非零售评级体系开发与校准、利率风险与流动性风险模型构建、客户行为分析、经济资本、以及衍生品交易对手风险方面工作。

黄柏翔 台湾金融工程师学会副秘书长、**GCPRM** 研发部主任

现任台湾金融研训院、上海陆家嘴人才金融城等知名官方两岸三地金融工程与风险管理议题的推广规划与特聘讲师；曾任统一证券新金部交易策略研发组顾问、政治大学财务工程研究中心、台湾金融工程师学会、铭传大学、淡江大学、中正大学、中国银行家论坛、台湾金融研训院、上海陆家嘴金融城人才发展中心全面风险管理特约讲座。