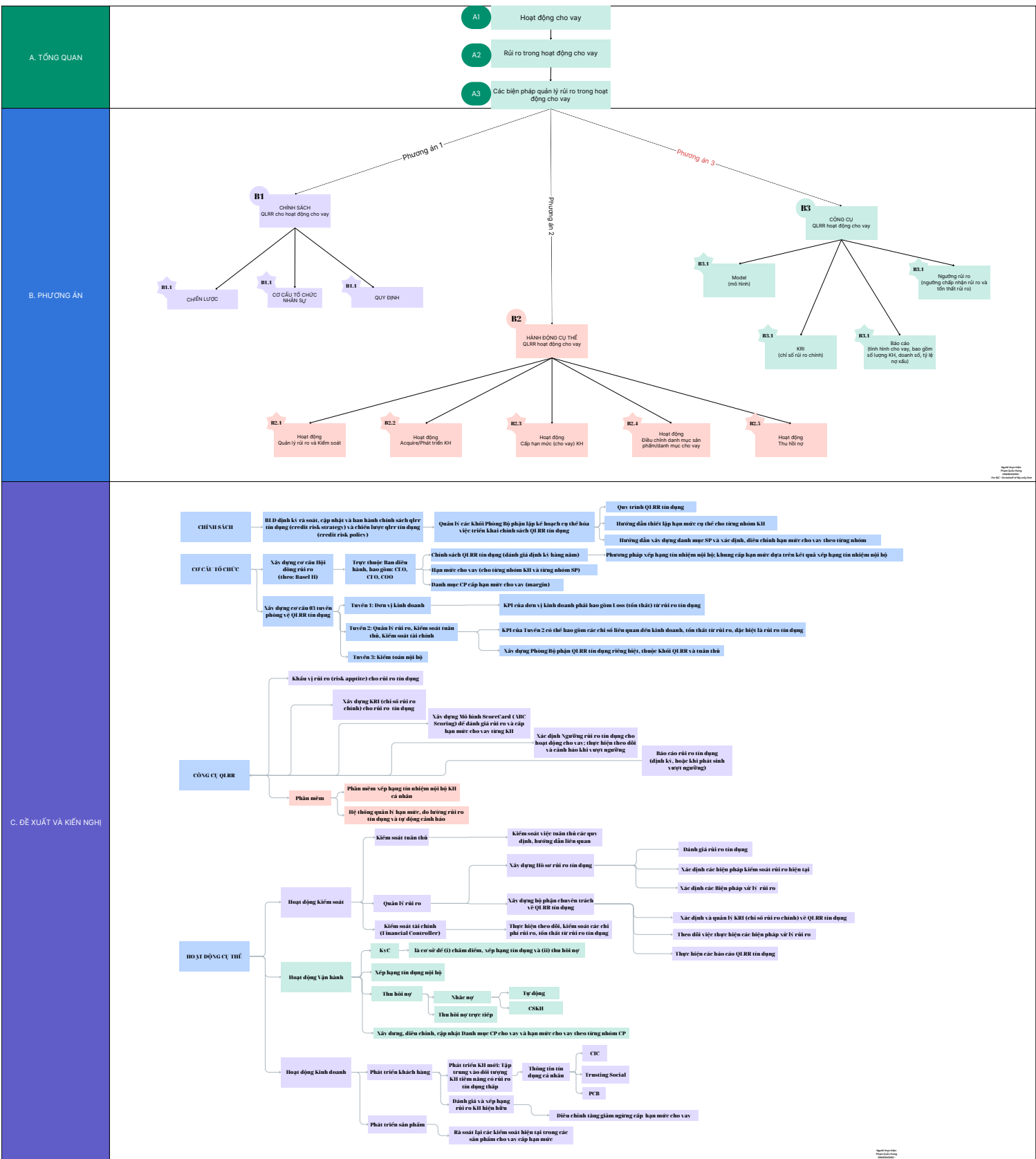


Xây dựng chính sách Quản lý rủi ro tín dụng



STT	Danh sách	Cấu phần tham chiếu
1	Thông tư 13/2018/TT-NHNN và văn bản sửa đổi; Thông tư 23/2020/TT-NHNN về các tỷ lệ bảo đảm an toàn trong hoạt động của TCTD phi ngân hàng	Rủi ro thị trường, rủi ro thanh khoản, rủi ro lãi suất trên số công ty, rủi ro tín dụng khách hàng định chế
2	Các thông tư liên quan hoạt động giao dịch liên ngân hàng; giao dịch ngoại hối; giao dịch phái sinh lãi suất; giao dịch cho vay, gửi tiền, mua bán có kỳ hạn giấy tờ có giá; mua bán trái phiếu chính phủ...	Rủi ro thị trường, rủi ro tín dụng đối tác
3	Hiệp ước quốc tế về vốn Basel II do Ủy ban Basel về giám sát ngân hàng ban hành 2004, hiệu lực 01/2007	Rủi ro thị trường, rủi ro thanh khoản, rủi ro lãi suất trên số công ty, rủi ro tín dụng khách hàng định chế
4	Stress testing principles của Ủy ban Basel 10/2018	Rủi ro thị trường
5	Revisions the Basel II market risk framework của Ủy ban Basel 02/2011	Rủi ro thị trường
6	BCBS 144 các nguyên tắc giám sát và quản trị rủi ro thanh khoản 09/2008	Rủi ro thanh khoản
7	BCBS 188 tiêu chuẩn đo lường và giám sát rủi ro thanh khoản Ủy ban Basel 12/2010	Rủi ro thanh khoản
8	BCBS 108 các nguyên tắc giám sát và quản trị rủi ro lãi suất trên số ngân hàng 07/2004	Rủi ro lãi suất trên số ngân hàng
9	Văn bản thống nhất quốc tế về đo lường và các chuẩn mực về vốn - Ủy ban Basel II 06/2006	Rủi ro lãi suất trên số ngân hàng
10	Phương pháp xếp hạng tín nhiệm cho ngân hàng của Moodys và Fitch	Rủi ro tín dụng khách hàng định chế