

# Fundamental Review of the Trading Book.

## 符合FRTB要求的数据集，大幅简化实施流程

为制定市场风险最低资本要求的全球标准，巴塞尔银行监管委员会（BCBS）全面改革了标准法（SA），并提出内部模型法（IMA）的修订框架。

无论是采用标准法还是内部模型法，银行都将面临挑战。为有效实施FRTB，银行必须全面审查并加强其风险架构和治理流程。同时，银行还需重新考量应以何种方式获取、调整和使用参考数据及市场数据，以满足更严格的数据监管要求。

为帮助银行实施FRTB，彭博推出一套数据解决方案，提供全面的参考数据和屡获殊荣的定价数据；加之近期发布的FRTB可观察数据，协助银行进行内模法所需的风险因子合格性测试。

### 参考与定价数据

彭博提供以下跨资产类别数据：

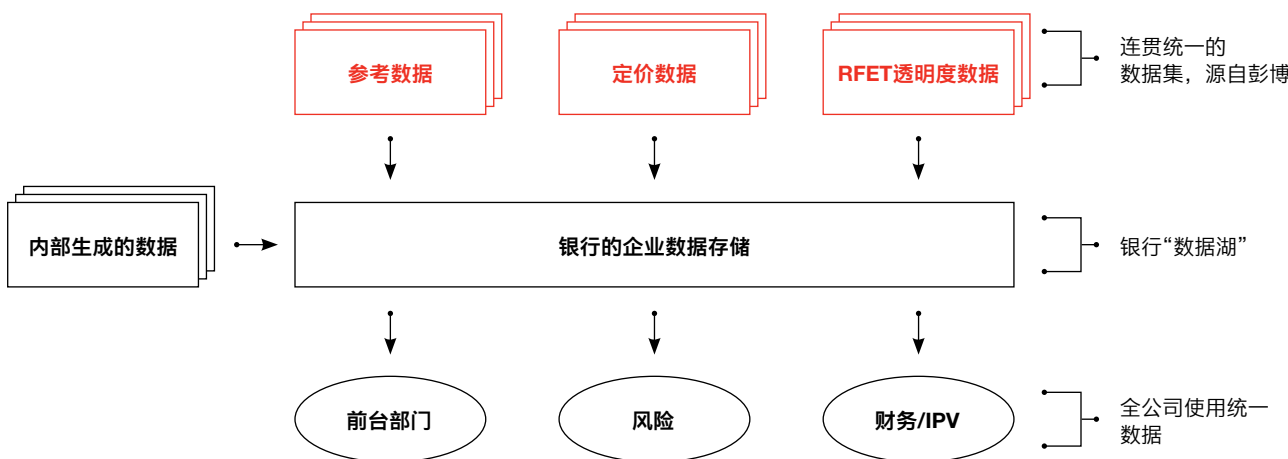
- 参考数据 — 条款与条件、行业分类、公司结构
- 市场数据 — 场内工具、债券价格、信用曲线、衍生产品数据
- 历史数据 — 10年以上（根据资产类别分类）

### FRTB“RFET”透明度数据

彭博的获奖定价数据新增了FRTB专用透明度数据，使银行可根据FRTB规则进行风险因子合格性测试：

- 符合规定的交易 + 承诺报价数量
- 季节性及其他信息
- RFET通过/失败标识

连贯统一的数据集共享一套代码系统，银行可放心地将数据传输至跨前、中、后台多个系统。



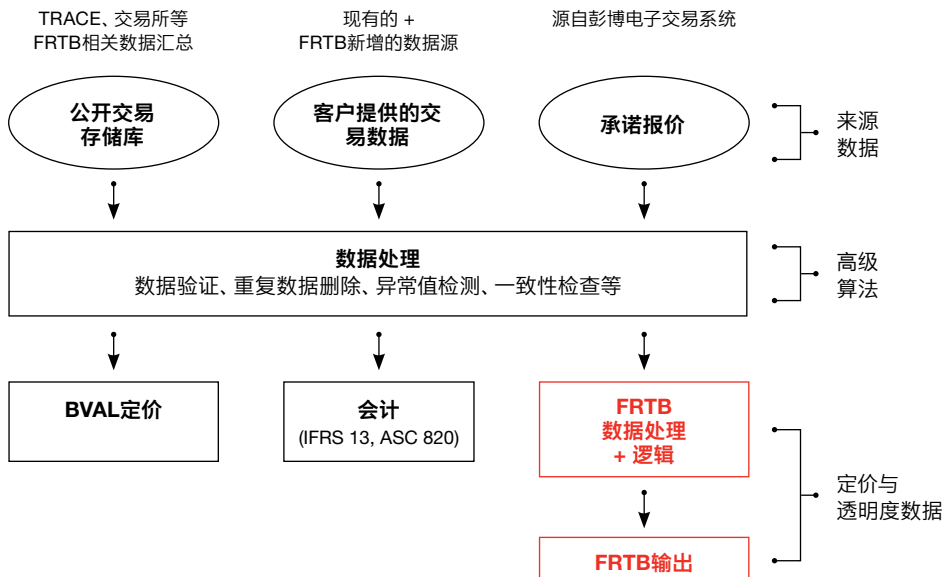
## 户提供的数据

数据可用性调查和概念验证均表明，数据汇总有助于减轻诸多市场中存在的稀疏数据问题，从而最大限度地降低风险因子在FRTB规则下被划归为不可建模的影响。

彭博可以利用现有的数据源平台，发挥独特优势来领导整个行业实施数据整合。

三大优势：

- 全行业认可
- 治理流程强大
- 启动便捷



## 彭博数据FRTB案例展示

### Classifications分类数据

彭博分类产品（BICS、BLCASS）提供证券和法人实体的行业分类和风险分类，用于协助标准法中的风险细分项目归类。此数据还可在内部模型法中用于风险汇总和代理识别，也可作为风险因子映射的输入值。

### 公司结构

彭博法人实体数据可在FRTB全流程中帮助银行了解金融工具与实体的联系、发行人/母公司、债务人关系和国家风险，进而将风险进行汇总。此数据也可用于风险因子映射和代理识别。

### 条款与条件和其他字段

彭博提供的数据与分类数据、公司结构、定价数据等保持一致，以确保在FRTB全流程中能够连贯一致地识别证券。彭博还提供其他数据集和字段，用于通过相关经济和风险特征来识别证券。

### FRTB RFET数据

彭博透明度数据可为每种金融工具和风险因子提供对应的RFET测试结果。若与分类数据、公司结构、其他条款与条件数据结合使用，还可将金融工具映射至对应的风险因子，并为仅有稀疏观测数据的工具识别替代。

### 历史数据

彭博为现金产品、场内工具、衍生品提供历史数据和分析，它们不仅可用于银行制定压力测试情景，还可帮助银行找到历史上损失最严重的12个月期间，以计算预期损失。

### 定价和衍生品数据

为确保客户系统中数据传输的一致性，彭博提供：

- 彭博评估定价服务（BVAL），为超过250万个金融工具每日多次提供评估定价。
- BVAL场外衍生品定价，提供所有资产类别的衍生品数据和分析。
- 其他可用定价来源，包括CBBT、BGN、BMRK以及全球各交易所的价格。

### 了解更多

如需了解我们将如何帮助贵公司自动处理数据需求，请访问 [bloomberg.com/FRTB](http://bloomberg.com/FRTB)，或通过 [eprise@bloomberg.net](mailto:eprise@bloomberg.net) 联系我们。



## 迈出下一步。

如需了解更多信息，请在彭博终端上按 <HELP> 键两次。

北京  
+86 10 6649 7500

上海  
+86 21 6104 3000

香港  
+852 2977 6000

伦敦  
+44 20 7330 7500

迪拜  
+91 22 6120 3600

纽约  
+1 212 318 2000

旧金山  
+1 415 912 2960

圣保罗  
+55 11 2395 9000

法兰克福  
+49 69 9204 1210

新加坡  
+65 6212 1000

悉尼  
+61 2 9777 8600

东京  
+81 3 4565 8900