

<<商业银行多维度风险管理体系研究>>

图书基本信息

书名：<<商业银行多维度风险管理体系研究>>

13位ISBN编号：9787504951601

10位ISBN编号：7504951609

出版时间：2010-3

出版时间：中国金融出版社

作者：王占峰

页数：141

版权说明：本站所提供下载的PDF图书仅提供预览和简介，请支持正版图书。

更多资源请访问：<http://www.tushu007.com>

## <<商业银行多维度风险管理体系研究>>

### 内容概要

本书的研究从多维度风险管理的各个维度进行了综合的论述和比较研究，本着问题导向的原则，在借鉴国外的成功管理经验的基础上，结合中国的实际情况，力图为探索一条符合中国国情的商业银行风险管理改革道路提出实用的政策建议。

本书适合从事相关研究工作的人员参考阅读。

## 作者简介

王占峰

1967年生，祖籍吉林榆树。

1987年考入吉林财贸学院，获金融学学士学位，2001年和2008年分别获西南财经大学金融学硕士学位和博士学位，目前在长江商学院攻读EMBA课程。

1991年到2003年分别在中国人民银行稽核监督局和办公厅工作，2003年起先后在中国人民银行青岛分行任副行长、青岛银监局任副局长，现任中国银行业监督管理委员会合作金融机构监管部副主任。

## 书籍目录

1 导论	1.1 研究背景与问题的提出	1.1.1 本书研究背景	1.1.2 问题的提出	1.2 基本概念与研究框架	1.2.1 商业银行风险管理的一般理论	1.2.2 商业银行风险管理的主要概念	1.3 国内外对商业银行风险管理的有关研究	1.3.1 国外商业银行风险管理研究状况	1.3.2 国内商业银行风险管理研究状况																					
2 我国商业银行风险管理现状	2.1 我国商业银行风险管理的结构性问题	2.2 我国商业银行风险管理中的非结构化问题	2.3 我国商业银行风险管理的多维度分析	2.3.1 四个维度风险的基本特征	2.3.2 四个维度风险的管理现状	3 我国商业银行的多维度风险管理体系	3.1 多维度风险管理概念的提出	3.1.1 风险关联度的概念	3.1.2 风险变动关联度的概念	3.1.3 多维度风险度量体系	3.1.4 多维度风险管理的概念	3.2 多维度风险管理体系的市场风险管理技术	3.2.1 敏感性分析	3.2.2 VaR模型	3.2.3 VaR的三要素	3.2.4 单一资产VaR的确定	3.2.5 组合资产VaR的确定	3.3 多维度风险管理体系的信用风险评估模型	3.3.1 Credit Metrics模型	3.3.2 Credit Risk+模型	3.3.3 KMV模型	3.3.4 麦肯锡cPV信贷组合观察模型	3.3.5 贝叶斯模型组合预测方法介绍	3.4 多维度风险管理体系的操作风险管理模型	3.4.1 单一指标法	3.4.2 多指标法	3.4.3 内部度量法	3.4.4 Buhfaman模型	3.5 多维度风险管理体系的流动性风险管理模型	3.6 多维度风险管理体系的应用
4 改进我国商业银行风险管理的对策和建议	4.1 加强我国商业银行信用风险管理改革的对策和建议	4.2 加强我国商业银行操作风险管理改革的对策和建议	4.2.1 构建完善的操作风险管理框架	4.2.2 建立清晰的操作风险管理组织结构	4.2.3 选取恰当的操作风险计量方法	4.2.4 建立健全相关制度	4.3 加强我国商业银行市场风险管理改革的对策和建议	4.3.1 建立完善的市场风险管理体系	4.3.2 大力发展衍生金融工具市场	4.3.3 借鉴《巴塞尔新资本协议》，大力推进商业银行利率风险管理	4.4 加强我国商业银行流动性风险管理的对策	4.4.1 设立专门的流动性风险管理部门	4.4.2 大力发展货币市场，扩展交易工具	4.4.3 加快金融创新步伐	4.4.4 进一步发展完善金融市场	4.4.5 加快利率市场化改革步伐	4.5 多维度风险管理体系的借鉴作用	4.6 结论及展望参考文献后记												

版权说明

本站所提供下载的PDF图书仅提供预览和简介，请支持正版图书。

更多资源请访问:<http://www.tushu007.com>