

<<经济资本与银行监管>>

图书基本信息

书名：<<经济资本与银行监管>>

13位ISBN编号：9787811386462

10位ISBN编号：7811386461

出版时间：2010-2

出版时间：西南财经大学出版社

作者：刘畅，张桥云，郭敏 编译

页数：128

字数：65000

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>

<<经济资本与银行监管>>

内容概要

本书的重点在于理解总体经济资本与模块之间关系的重要性，以及确保基本模块(个体风险评估)以一种连贯一致的方式进行度量的重要性。

本书的主体部分重点讨论的是计算总体经济风险所涉及的问题，而并不是计算经济资本涉及的的相关风险。

所以，我们重点讨论对经济资本的运用和管理，以及与风险度量方法的选择、风险汇总和经济资本验证的相关问题。

此外，经济资本的三个重要的模块(信用风险的相关性模块，交易对手的信用风险和银行账户的利率风险这两大模块)将在附录中进行研究。

这份模块的清单是基于它们对议题的重要性和复杂性来选的，还有部分原因是这些议题(交易对手信用风险除外)在巴塞尔新资本协议框架的第一支柱里没有提到。

但是，我们应注意的是这份清单并没有覆盖所有内容。

<<经济资本与银行监管>>

书籍目录

· 引言 · 经济资本度量的运用和监管 A. 业务层面的运用 B. 企业范围的运用 C. 监督管理 D. 与经济资本运用和管理有关的监管问题 · 风险度量 A. 风险度量应具备的特征 B. 风险度量的类型 C. 风险度量的计算 D. 与风险度量有关的监管问题 · 风险汇总 A. 汇总框架 B. 汇总方法 C. 汇总的一系列做法 D. 与风险汇总有关的监管问题 · 经济资本内部模型的验证 A. 使用的验证过程 B. 验证过程包括的内容 C. 与验证过程有关的监管问题附录1 信用风险模型的相关性建模附录2 交易对手的信用风险附录3 银行账户的利率风险

<<经济资本与银行监管>>

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>