第一图书网, tushu007.com

<<商业银行操作风险度量与监管资本测定>>

图书基本信息

书名：<<商业银行操作风险度量与监管资本测定>>

13位ISBN编号：9787030360465

10位ISBN编号：703036046X

出版时间：2013-3

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

内容概要

鉴于操作风险对银行造成的损失，《新巴塞尔资本协议》把操作风险纳入风险管理框架，要求金融机构为操作风险配置相应的资本金以增强银行稳定性。
虽然《新巴塞尔资本协议》允许并鼓励银行采用适合自己的高级计量法度量操作风险并进行资本金测定，但是并没有给出具体的方法。
合理地度量商业银行的操作风险，准确地为操作风险分配适当的资本金是商业银行操作风险管理的重点和必要环节。

《商业银行操作风险度量与监管资本测定：理论、方法与实证》围绕“中国商业银行的操作风险到底有多大”这一基本问题展开研究，并根据操作风险的损失的厚尾性，内部数据的缺失性，外部数据、情景数据和管理数据的主观性，数据的有偏性，计算结果的准确性，采用过去的数据计算未来操作风险损失的合理性，操作风险单元之间的相关性等特点，分别采用初级计量法、极值理论、损失分布法、多维模型等方法度量我国商业银行的操作风险资本金。

《商业银行操作风险度量与监管资本测定：理论、方法与实证》适合银行监管领域的政府公务人员、银行管理人员、高等院校师生、科研人员及相关工作者阅读。

第一图书网, tushu007.com
<<商业银行操作风险度量与监管资本测定>>

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