

<<巴塞尔新资本协议>>

图书基本信息

书名：<<巴塞尔新资本协议>>

13位ISBN编号：9787504960078

10位ISBN编号：7504960071

出版时间：2011-9

出版时间：中国金融出版社

作者：章彰

页数：357

字数：440000

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>

<<巴塞尔新资本协议>>

内容概要

中银香港是中国银行业在境外获得监管机构批准的第一家实施内部评级法的中资银行。在中银香港实施内部评级法的过程中，如何准确把握内部评级法权重设计公式中蕴含的监管机构的风险偏好，如何从监管资本占用的角度比较不同类型业务风险的大小，如何针对低违约组合(如银行、大型企业、项目融资、物品融资等)设计和开发违约概率计量模型，零售中小企业的违约概率模型与住宅按揭贷款、信用卡等零售违约概率模型相比有何相似之处，零售组合的违约损失率和违约暴露模型结构有何特质……《巴塞尔新资本协议——监管要求与实施中的问题》的作者章彰曾长期担任中银香港IRB

项目的高级管理人员，主责项目合规和模型验证。

《巴塞尔新资本协议——

监管要求与实施中的问题》以巴塞尔协议II和III的监管要求为指导，结合中银香港在IRB项目实施中遇到的具体问题，全面阐述了内部评级法下各类信用风险模型的设计、开发、验证、应用过程，同时剖析了市场风险标准法、内部模型法和操作风险标准法，以及第二支柱下各类风险及资本管理的实际问题，对我国银行业统筹实施内部评级法和巴塞尔协议III有重要的借鉴意义。

<<巴塞尔新资本协议>>

作者简介

章彰，1972年出生，2000年在中国社会科学院研究生院获得世界经济专业博士学位。

2000年进入中国银行总行风险管理部工作，先后任风险管理部规划处副处长、内控团队主管等职，以及中国银行风险管理委员会专家组成员。

2006年3月外派中银香港风险管理部，任《巴塞尔新资本协议》执行办公室规划与合规主管。

2009年2月任中银香港风险管理部模型验证主管。

2004年参与了中国银监会对《巴塞尔新资本协议》的中文翻译工作。

曾在《金融时报》、《经济日报》、《国际金融研究》、《银行家》、《证券市场导报》等报刊杂志上发表多篇文章。

2002年在中国人民大学出版社出版了《商业银行信用风险管理——兼论巴塞尔新资本协议》一书，并获得中国金融教育科研成果一等奖。

2005年在中国经济出版社出版了《解读巴塞尔新资本协议》。

<<巴塞尔新资本协议>>

书籍目录

- 第一章 新协议与银行风险管理的观念变革
 - 第一节 银行实施新资本协议的策略和组织问题
 - 第二节 新协议内部评级法的关键概念
- 第二章 新协议的监管导向
 - 第一节 资产分类与信用风险加权资产的覆盖范围
 - 第二节 标准法下不同类型业务 / 产品监管资本占用的比较
 - 第三节 内部评级法下不同暴露的监管资本占用
- 第三章 低违约组合(Low Default Portfolio)——银行暴露
 - 第一节 银行类债务人的内部评级方法
 - 第二节 银行类债务人内部评级体系的运用
- 第四章 企业暴露的模型与政策
 - 第一节 内部评级模型的方法论
 - 第二节 专项贷款评级模型
 - 第三节 中小企业的风险模型与内部管理体系
- 第五章 零售暴露风险计量模型的开发与运用
 - 第一节 住宅按揭暴露关键风险参数估计及应用
 - 第二节 信用卡的风险计量
- 第六章 内部评级体系的全面验证
 - 第一节 内部评级法对验证的基本要求
 - 第二节 模型的定量验证方法
- 第七章 其他暴露的风险计量
 - 第一节 股权暴露的风险计量
 - 第二节 信用衍生工具的风险计量
 - 第三节 证券化资产的风险计量
- 第八章 市场风险和操作风险的合规管理
 - 第一节 市场风险标准法的监管要求及应用
 - 第二节 市场风险内部模型法
 - 第三节 操作风险的监管要求与内部管理
- 第九章 建立内部资本评估机制(ICAAP)
 - 第一节 第二支柱下主要风险的内部管理
 - 第二节 内部资本计算与资本管理
- 附件
- 参考文献
- 后记

<<巴塞尔新资本协议>>

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>