

<<商业银行风险计量理论与实务>>

图书基本信息

书名：<<商业银行风险计量理论与实务>>

13位ISBN编号：9787504960528

10位ISBN编号：7504960527

出版时间：2011-9

出版时间：中国金融

作者：梁世栋

页数：368

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>

## <<商业银行风险计量理论与实务>>

### 内容概要

随着我国银行业对风险计量工作的重视，已有不同书籍从不同的侧重点对风险计量进行过一定的介绍，但尚未有类似于本书这样全面介绍风险计量实务的书籍面世。

需要强调的是，本书并不是前人工作成果的简单整理和理论总结，而是结合了本人的实践探索经验进行系统性的论述，同时在相关方面有所侧重。

一是内容上的侧重，如已经有专门的书籍论述市场风险价值VaR模型，所以本书对于风险价值模型本身没有详细展开，而对于利率期限结构模型和市场风险管理体系则浓墨重彩，重点单独成章。

二是侧重风险计量的业务应用，例如评分卡模型章节，不仅仅按步骤一步一步详细地讲述了建模实践，同时讨论了评分卡应用的业务流程、政策、制度和IT系统实现。

## <<商业银行风险计量理论与实务>>

### 作者简介

梁世栋

中债信用增进公司董事、风险总监。

曾任中国建设银行风险管理部处长等职，拥有北美准精算师ASA和金融分析师CFA的执业资格。

毕业于中国科学技术大学，获得材料化学和经济管理双学士学位、金融工程博士学位，博士毕业后进入香港政府“内地人才引进计划”，在香港大学商学院从事研究工作。

现为北京大学硕士论文评审专家、中央财经大学硕士研究生校外导师。

主要研究方向为金融稳定与金融风险管理，具体研究领域包括巴塞尔资本协议、风险计量与应用、压力测试、信用衍生产品、固定收益、经济资本与绩效考核、资本市场实证分析，发表近40篇学术论文和评论文章。

<<商业银行风险计量理论与实务>>

书籍目录

- 第一章 巴塞尔
- 第二章 最低资本要求
- 第三章 巴塞尔
- 第四章 非零售风险暴露内部评级
- 第五章 信用风险高级计量模型
- 第六章 零售信贷业务风险信用评分
- 第七章 零售风险暴露内部评级
- 第八章 信用评级模型综述
- 第九章 市场风险计量与管理
- 第十章 操作风险计量与管理
- 第十一章 内部评级模型验证
- 第十二章 压力测试
- 第十三章 经济资本
- 附件
- 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>