

《巴塞尔新资本协议：监管要求与实施中的问题》

书籍信息

版次：1

页数：357

字数：440000

印刷时间：2011年09月01日

开本：16开

纸张：胶版纸

包装：平装

是否套装：否

国际标准书号ISBN：9787504960078

编辑推荐

章彰所著的《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。

内容简介

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、*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。

作者简介

?? ????
?? ????
?? ????
?? ????
?? ????
?? ???? (ICAAP)
?? ????
?? ????
??
???
??

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www.tushupdf.com](http://www.tushupdf.com)