

<<Basel II在中资银行的实践>>

图书基本信息

书名：<<Basel II在中资银行的实践>>

13位ISBN编号：9787300074573

10位ISBN编号：730007457X

出版时间：2006-7

出版时间：中国人民大学出版社

作者：周玮

页数：427

字数：485000

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>

<<Basel II在中资银行的实践>>

内容概要

在香港刚刚经历了亚洲金融风暴的洗礼以后，作者便被中国银行总行派往香港从事风险管理工作，配合银行管理变革的需要，着手准备开展进行信用风险管理变革项目。

该项目是当时香港同业中最早启动的，具有巴塞尔新资本协议实施特点的项目，项目于2001年正式启动，目标是：参考巴塞尔新资本协议精神，结合银行经营环境和自身实际，通过建立内部评级体系、损失预测、风险定价、组合管理和资本管理模型，并将其在一套综合的风险管理系统中实施，借此推动授信业务流程、组织架构及政策制度的变革，最终实现经风险调整后的股东回报最大化。

本书将该项目实施过程中形成的研究文章进行了整理和汇总。

全书分为两个部分：一部分是理论篇，主要是围绕着巴塞尔新资本协议进行的讨论；另一部分是实践篇，主要是作者在进行信用风险管理变革项目时进行的项目专题汇报。

这些文章无论是对风险管理初学者，还是对风险管理实践者都是开卷有益的。

<<Basel II在中资银行的实践>>

作者简介

周玮，国家审计署高级审计师、中国银行高级经济师。
现任中国银行稽核委员会风险稽核专员，曾任中国银行风险管理部副总经理、中国银行（香港）有限公司风险管理部副总经理和中国银行（香港）有限公司信用风险管理改革项目管理委员会主任。
先后在《经济研究参考》、《中国

<<Basel II在中资银行的实践>>

书籍目录

上篇 理论篇 【1】现代商业银行信用风险管理的基本要素 【2】风险管理对商业银行利润的长期稳定增长的作用 【3】国际银行业流动性风险监管标准的演变 【4】信用衍生工具市场迅速发展地金融机构的影响 【5】巴塞尔新资本协议对资产证券化的资本要求 【6】巴塞尔新资本协议对操作性风险的界定及其演变 【7】商业银行实施操作风险管理的规划构思 【8】国际银行实施先进风险管理的情况分析 【9】风险调节绩效管理与银行资本管理的关系 【10】市场纪律对信用风险的要求 【11】新资本协议对信用风险的监管资本要求及其含义 【12】商业银行内部评级系统运作设计和配套管理 【13】如何有效推行符合巴塞尔新资本协议的内部评级法 【14】现代商业银行信用风险管理 with 信贷管理的区别 【15】对内部评级系统管理的要求 【16】应用压力测试评估风险 【17】授信期限对授信风险的影响 【18】押品对信用风险的缓解作用 【19】现代商业银行内部企业绩效管理 with 风险管理的发展 【20】商业银行各风险管理部门与司库在经济资本管理经营中的关系 【21】现代商业银行资本管理 with 风险管理的关系

下篇 实务篇 【22】香港金融管理局对内部评级法的要求 【23】商业银行在技术上准备实施内部评级法的方法 【24】评分卡验证方法 【25】银行设定评分卡合格分的方法 【26】利用评级模型预测违约率 【27】授信组合风险管理 【28】授信风险压力测试 【29】美国太阳信托银行发展全面信贷风险评级系统对中国商业银行的启示 【30】数据挖掘 【31】经济资本计算工具的对比 【32】开发内部评级模型的方法 【33】新资本协议中资本的覆盖范围

<<Basel II在中资银行的实践>>

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>