

<<基于VaR的商业银行风险管理>>

图书基本信息

书名：<<基于VaR的商业银行风险管理>>

13位ISBN编号：9787500462859

10位ISBN编号：7500462859

出版时间：2007-6

出版时间：中国社会科学出版社

作者：刘晓星

页数：202

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>

## <<基于VaR的商业银行风险管理>>

### 内容概要

本书是关于“基于VaR的商业银行风险管理”的专著，全书对VaR在银行领域的风险管理做一个比较全面的研究。

书中首先对VaR的算法进行研究和实证分析，然后建立基于VaR的银行资本配置模型，该模型考虑了银行的交易费用、风险偏好和经营策略，并在此基础上进一步扩展到银行风险资本配置与绩效评估；接着研究基于VaR的银行监管与银行风险策略，基于VaR的银行信用风险管理和VaR约束下的银行投资组合选择，建立基于CVaR的银行投资组合优化模型；最后，基于VaR的视角，研究银行的操作风险度量，并针对我国银行业展开实证分析。

该书系统地介绍了VaR的理论基础和计算方法及其局限性，建立了在静态和动态条件下基于VaR的银行资本优化模型。

分析了VaR和风险资本(CaR)之间的内在联系，结合我国金融发展现状，对金融监管、资本投资、风险控制等做了深入研究，提出了我国现阶段基于RAROC的商业银行全面风险管理框架和统一于VaR的银行风险资本配置思路。

最后对银行操作风险度量进行了实证分析，提出了基于VaR的银行整体风险管理框架和操作风险管理在我国的应用建议。

<<基于VaR的商业银行风险管理>>

作者简介

刘晓星，男，湖南隆回人，1970年9月出生。  
金融学硕士、管理科学与工程博士、金融学博士后、副教授、金融学硕士生导师。  
先后就读于西南工学院、西北农林科技大学、东南大学，现执教于广东商学院金融学院。  
主要研究领域为金融工程与风险管理。  
近五年来，先后在《南开管理

## &lt;&lt;基于VaR的商业银行风险管理&gt;&gt;

## 书籍目录

0 绪论 0.1 商业银行风险管理的历史演进 0.2 VaR与商业银行风险管理 0.3 选题意义与国内外研究综述 0.4 主要内容与创新点第一章 VaR的基本原理与应用分析 1.1 风险与资产回报 1.2 VaR的数学表述 1.3 VaR的参数选择 1.4 VaR的计算原理 1.5 VaR的计算方法 1.6 VaR方法的扩展及其模型检验 1.7 VaR的应用：基于VaR—EGARCH—GED模型的深圳股票市场波动性分析 1.8 本章小结第二章 基于VaR的银行资本优化模型研究 2.1 静态条件下银行资本优化模型 2.2 动态条件下的银行资本优化模型 2.3 本章小结第三章 基于VaR的银行风险资本配置与绩效评估 3.1 风险资本与风险调整的银行绩效测量 3.2 RAROC的VaR确定 3.3 风险资本的计量 3.4 基于RAROC的银行信贷风险资本估计 3.5 银行信贷样本组合的RAROC计算 3.6 银行风险资本配置与风险限额管理 3.7 绩效评估与资本配置在我国银行业的应用 3.8 本章小结第四章 基于VaR的银行监管 4.1 VaR与新巴塞尔资本协议 4.2 基于VaR的银行监管与银行风险策略 4.3 实证分析 4.4 本章小结第五章 基于VaR的银行信用风险管理 5.1 银行信用风险度量 5.2 基于VaR的商业银行资产负债管理 5.3 本章小结第六章 基于VaR的银行投资风险管理 6.1 VaR约束下的银行资产配置模型 6.2 基于CVaR的投资组合优化模型研究 6.3 本章小结第七章 基于VaR的银行操作风险管理 7.1 新巴塞尔资本协议与操作风险 7.2 操作风险度量方法及其应用分析 7.3 银行操作风险管理的发展趋势分析 7.4 新巴塞尔资本协议下我国商业银行的操作风险管理 7.5 操作风险度量：国内上市银行的实证分析 7.6 本章小结第八章 结论与研究展望 8.1 本书的主要结论 8.2 本书研究的主要创新点 8.3 进一步研究的方向参考文献后记

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>