

<<新资本协议>>

图书基本信息

书名：<<新资本协议>>

13位ISBN编号：9787807067702

10位ISBN编号：7807067705

出版时间：2008-5

出版地：上海远东

作者：王胜邦，陈颖 编译

页数：329

字数：320000

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>

## <<新资本协议>>

### 内容概要

自1999年巴塞尔委员会公布新资本协议第一轮征求意见稿以来，信用风险内部评级法一直是国际银行监管领域最为关注的领域。

本书编译者在理论研究和相关规章起草的过程中，参考并翻译了巴塞尔委员会发布的一系列监管政策、国外研究文献和其他监管当局发布的监管规章。

本书的选编反映了他们作为银行监管人员的职业特点，着重于监管技术的讨论和监管政策的解读，并重点立论了国际化大银行先进的风险计量技术的政策含义。

## <<新资本协议>>

### 作者简介

王胜邦，男，安徽凤阳县人，经济学博士，现任中国银监会国际部国际监管研究处副处长，中国银监会新资本协议研究和规划项目组，《有效银行监管核心原则》自我评估项目组核心成员，参与起草了《商业银行资本充足率管理办法》、《中国银行业实施新资本协议指导意见》、《商业

## <<新资本协议>>

### 书籍目录

编译前言第一部分 内部评级法技术原理 1.信用风险模型和银行内部资本配置的实践：基于模型的资本监管标准的意义 2.采用信用风险模型计提监管资本：问题和对策 3.新资本协议内部评级法风险权重函数的解释性说明第二部分 信用风险建模与计量 4.时点评级——跨周期评级体系的设计与实施 5.资产组合信用风险计量的表达和校验误差：针对ASRF模型的研究 6.贷款集中度风险的计量和管理 第三部分 内部评级体系验证与运用 7.内部评级体系验证研究 8.内部评级体系的开发和运用：日本银行业的经验第四部分 内部评级法相关监管政策 9.AIG有关新资本协议框架下验证工作的最新进展 10.新资本协议框架下低违约资产组合的验证 11.内部评级法框架下使用外部产品的监管问题 12.内部评级法使用测试：背景和实施 13.交易账户违约风险新增资本计提指引

<<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>