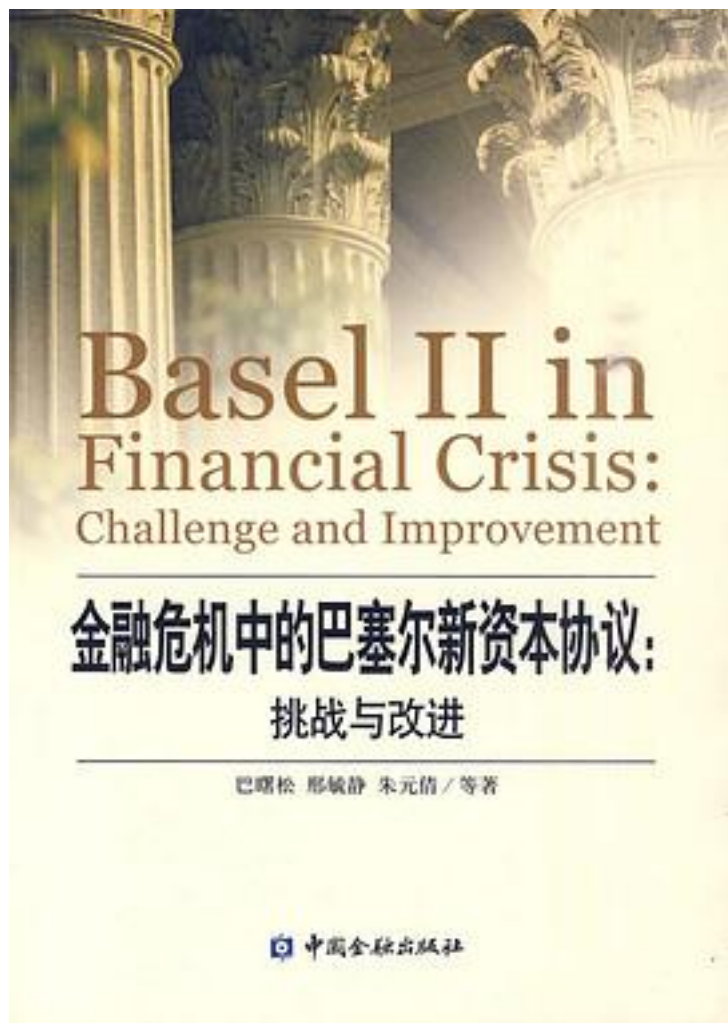


金融危机中的巴塞尔新资本协议



[金融危机中的巴塞尔新资本协议_下载链接1](#)

著者:

出版者:

出版时间:2010-4

装帧:

isbn:9787504954558

《金融危机中的巴塞尔新资本协议:挑战与改进》共分为五篇，详细的讲述了金融危机

的相关问题。现在，金融危机仍在演进当中，还可能出现新情况和新问题，巴塞尔新资本协议必然也会面临新的挑战，从这个角度来说，《金融危机中的巴塞尔新资本协议：挑战与改进》可能算是抛砖引玉，希望能够借此促使更多关心国际金融监管发展以及提高中国金融监管发展水平的研究者共同关注巴塞尔新资本协议的研究，推进中国企业风险管理研究的不断发展。

作者介绍:

巴曙松，研究员，国务院发展研究中心金融研究所副所长，博士生导师。
巴曙松研究员为享受国务院特殊津贴专家，中央国家机关青联常委，中国宏观经济学会副秘书长，中国银行业协会首席经济学家，还担任中国人力资源和社会保障部企业年金资格评审专家、中国证监会基金评议专家委员会委员、中国银监会考试委员会专家、招商银行和招商局香港总部的博士后专家指导委员会委员等，先后担任中国银行杭州市分行副行长、中银香港助理总经理、中国证券业协会发展战略委员会主任、中央人民政府驻香港联络办公室经济部副部长等职务。巴曙松研究员还曾担任中共中央政治局集体学习主讲专家，并在中国科学技术大学、北京大学、华中科技大学、南开大学、中山大学、苏州大学等高校担任兼职教授，主要著作有：《巴塞尔新资本协议研究》、《中国金融市场发展路径研究》、《美国货币史》（译著）等。邢毓静，经济学博士，现任中国人民银行货币政策二司副司长，先后在国家外汇管理局国际收支司、中国人民银行办公厅、中国人民银行货币政策司等任职，主要著作有：《放松资本管制的过程》（中国金融出版社2004年版）、《经济全球化与中国金融运行》（中国金融出版社2000年版），并担任华中科技大学兼职教授。

朱元倩，中国科学技术大学金融工程方向博士研究生，美国北卡大学夏洛特分校联合培养。在《金融研究》、《管理世界》等国内外核心期刊发表学术论文二十余篇。

目录: 第一篇 宏观趋势与监管动态

第一章 金融危机前后饱受“争议”的巴塞尔资本协议

- 一、巴塞尔资本协议的缺点和不足
- 二、金融创新和监管套利挑战协议秉承的监管成规
- 三、金融危机引发新资本协议的新争议
- 四、巴塞尔新资本协议不应成为金融危机的替罪羊

第二章 从金融危机后巴塞尔新资本协议的修订看金融监管体制的演进与回归

- 一、金融危机后巴塞尔委员会对新资本协议的修订
- 二、金融危机后国际监管机构的动态
- 三、监管标准的深化和细化
- 四、监管模式的演进
- 五、监管理念和实施细节中的回归趋势
- 六、对巴塞尔新资本协议进一步修订方向的分析 and 展望

第二篇 资本约束与资本计提

第三章 银行监管指标的再讨论：资本充足率与杠杆率

- 一、监管指标的概述：资本充足率与杠杆率
- 二、巴塞尔委员会对银行资本充足率要求的演进
- 三、8%的资本充足率标准面临的挑战
- 四、对资本充足率监管新标准的预测和探讨
- 五、引入杠杆率监管：金融危机后的监管新任务

第四章 金融危机中资产证券化的新特征及监管新动态

- 一、资产证券化的基本状况
- 二、金融危机前后资产证券化发展的新特征
- 三、巴塞尔资本协议下资产证券化监管框架演进
- 四、巴塞尔新资本协议的资产证券化监管在金融危机中暴露的问题
- 五、金融危机后资产证券化监管及行业自律的新动态
- 六、巴塞尔新资本协议资产证券化监管新趋势

第五章 巴塞尔新资本协议下交易账户的监管及新增风险

- 一、交易账户与银行账户
- 二、巴塞尔资本协议下交易账户监管的演进趋势
- 三、交易账户的新增风险
- 四、新增风险的风险因素识别和计算准则
- 五、新增风险的争议、应用难点与完善方向

第三篇 风险测度模型的演进与创新

第六章 国际银行实施内部评级法的评价及其顺经济周期效应的缓释方法

- 一、内部评级法概述
- 二、定量影响测试与内部评级法改进
- 三、内部评级法的评价
- 四、内部评级法顺经济周期效应及缓释方法

第七章 现代商业银行的风险新特征及测量模型的变迁

- 一、现代商业银行的特征和新风险
- 二、市场风险的概况
- 三、操作风险及其新特征
- 四、流动性风险
- 五、全面风险的测量模型和管理框架
- 六、现代商业银行风险管理的完善和展望

第八章 运用VaR模型测量银行风险的局限性及其改进

- 一、巴塞尔新资本协议下VaR方法的运用
- 二、传统的VaR方法的介绍及体系演变
- 三、用传统VaR模型度量银行风险暴露的不足之处
- 四、基于银行数据的VaR模型效果评估
- 五、传统VaR模型的改进
- 六、回溯测试

第九章 压力测试在银行风险管理中的理论探讨和实践经验

- 一、压力测试的概述
- 二、压力测试的分析方法
- 三、压力测试的执行
- 四、不同风险因子的模型讨论
- 五、压力测试的国际实践现状及应用启示
- 六、中国的实施进展和后续研究方向

第四篇 监督审查和市场约束

第十章 从微观审慎监管到宏观审慎监管：危机下的银行业监管启示

- 一、宏观审慎监管的理论分析
- 二、金融危机后宏观审慎监管的必要性分析
- 三、宏观审慎监管的实施
- 四、欧洲应对金融危机的宏观审慎监管思路
- 五、宏观审慎监管的未来之路
- 六、中国落实宏观审慎监管模式的优势和挑战

第十一章 巴塞尔资本协议下跨境银行监管合作的国际经验及启示

- 一、母国-东道国监管的责任划分与监管方式的选择
- 二、实现有效的跨境监管合作面临的困难
- 三、金融危机后的监管新思路 and 巴塞尔委员会的改革建议
- 四、全球监管合作现状和实践经验
- 五、中国在跨境银行监管合作中的参与介入和法律的完善

第十二章 从有效市场约束看第三支柱下中国银行业的监管现状

- 一、市场约束的理论框架
- 二、关于有效市场约束的争议
- 三、金融危机对市场约束的启示
- 四、境外银行业第三支柱下的实施进展
- 五、中国市场约束实施的理论分析

第五篇 实施影响和经验借鉴

第十三章 后危机时代中国实施巴塞尔新资本协议的货币政策选择

一、当前的经济环境和研究背景

二、资本约束影响货币政策传导机制的渠道分析

三、货币政策影响渠道有效性的实证分析

四、银行资本约束对货币政策传导效果的影响

五、巴塞尔新资本协议对货币政策传导的影响

第十四章 中国银行业实施巴塞尔新资本协议的现状、挑战和建议

一、中国银监会关于巴塞尔新资本协议实施的规范性文件解读

二、新资本协议银行实施巴塞尔新资本协议的进展

三、第一支柱实施的问题和挑战

四、第二支柱实施的挑战

五、对目前尚未实施巴塞尔新资本协议的商业银行的建议

六、中国银行业实施巴塞尔新资本协议的监管要点分析

参考文献

后记

• • • • •

([收起](#))

[金融危机中的巴塞尔新资本协议_下载链接1](#)

标签

金融

巴塞尔

巴曙松

银行

经济学

国际经济学

资产证券化

经济

评论

对三大支柱有了了解

各种看不懂，天天背着重死了，先去书库还了，为了回头做尾注mark一记。

[金融危机中的巴塞尔新资本协议_下载链接1](#)

书评

该书已经入围2010第一财经\信诚基金年度金融书籍(欢迎前来加入我们“年度金融书籍小组” <http://www.douban.com/group/281617/>)

[金融危机中的巴塞尔新资本协议_下载链接1](#)