

商业银行风险计量理论与实务



[商业银行风险计量理论与实务_下载链接1](#)

著者:梁世栋

出版者:中国金融

出版时间:2011-9

装帧:

isbn:9787504960528

《商业银行风险计量理论与实务:〈巴塞尔资本协议〉核心技术(修订版)》 自铺陈纸笔伊

始，我和出版社对于这本专业性强、受众面小的书籍在销售方面就没抱太多期望，坚持成书主要还是出于对记录、总结我国商业银行风险计量的那一段历史和经验的责任感，甚至出版社也是看在我是一个专业的认真写书人份儿上而给予了支持。没有想到的是，出版后销售情况竟然还可以，陆陆续续销售一空后，订购需求仍然旺盛。这一方面说明我国关注和从事商业银行风险计量的人员在增加，侧面反映出我国商业银行在风险管理精细化方面的努力和进步；另一方面也说明读者对我的辛勤劳作还是较为认可，于是才有了编辑和我商量再版事宜的桥段。

作者介绍:

梁世栋，中债信用增进公司董事、风险总监。曾任中国建设银行风险管理部处长等职，拥有北美准精算师ASA和金融分析师CFA的执业资格。毕业于中国科学技术大学，获得材料化学和经济管理双学士学位、金融工程博士学位，博士毕业后进入香港政府“内地人才引进计划”，在香港大学商学院从事研究工作。现为北京大学硕士论文评审专家、中央财经大学硕士研究生校外导师。主要研究方向为金融稳定与金融风险管理，具体研究领域包括巴塞尔资本协议、风险计量与应用、压力测试、信用衍生产品、固定收益、经济资本与绩效考核、资本市场实证分析，发表近40篇学术论文和评论文章。

目录: 第一章 巴塞尔 II 第一节 《巴塞尔资本协议》的演进过程 第二节 巴塞尔 II 框架及特点 第三节 中国银行业实施巴塞尔 II 的进程 第四节 中国商业银行实施巴塞尔 II 的意义 第二章 最低资本要求 第一节 资本充足率 第二节 信用风险 第三节 市场风险 第四节 操作风险 第三章 巴塞尔 III 第一节 巴塞尔 2.5 第二节 宏观审慎管理 第三节 微观审慎监管 第四节 有关巴塞尔 III 的若干议题 第四章 非零售风险暴露内部评级 第一节 非零售风险暴露内部评级要求 第二节 公司和金融机构客户评级模型 第三节 模型应用与跟踪 第四节 主权敞口内部评级模型 第五节 违约损失率模型 第五章 信用风险高级计量模型 第一节 信用利差风险 第二节 信用风险高级计量模型 第三节 CreditMetrics 模型 第四节 KMV 模型 第五节 CreditRisk+ 模型 第六节 CreditPortfolioView 模型 第七节 信用风险期限结构模型的结构模型 第八节 信用风险期限结构模型的强度模型 第六章 零售信贷业务风险信用评分 第一节 信用风险评分卡 第二节 评分卡模型开发 第三节 基于评分卡模型的零售产品风险管理 第七章 零售风险暴露内部评级 第一节 零售风险暴露内部评级要求 第二节 资产池分池技术 第三节 核心参数估计——违约概率 第四节 核心参数估计——违约损失率 第五节 核心参数估计——违约敞口 第六节 资产池分池验证 第八章 信用评级模型综述 第一节 判别分析 第二节 logistic 回归 第三节 人工神经网络判别分析 第四节 遗传算法 第五节 决策树 第六节 最近邻法 第七节 模型开发应注意的问题 第九章 市场风险计量与管理 第一节 市场风险的定义以及分类 第二节 市场风险的内部模型法 第三节 市场风险的静态计量工具 第四节 市场风险的现代计量方法-VaR 第五节 市场风险管理体系 第十章 操作风险计量与管理 第一节 操作风险定义和分类 第二节 操作风险管理政策 第三节 操作风险高级计量方法 第四节 操作风险管理工具 第十一章 内部评级模型验证 第一节 模型验证制度 第二节 模型验证定量指标 第十二章 压力测试 第一节 压力测试概述 第二节 压力测试的工作流程 第三节 信用风险压力测试 第四节 市场风险压力测试 第五节 流动性风险压力测试 第六节 操作风险压力测试 第七节 风险传染 第十三章 经济资本 第一节 经济资本概念 第二节 经济资本计量 第三节 信用风险的经济资本计量 第四节 市场风险的经济资本计量 第五节 其他风险的经济资本计量 第六节 总体资产的经济资本 第七节 经济资本与全面风险管理 附件 参考文献 后记
• • • • • (收起)

[商业银行风险计量理论与实务_下载链接1](#)

标签

风险管理

金融

银行

数据分析

专识积淀

内评

入门的好书

评论

可以作为巴二的体系的总结性工具书，里面的定量部分非常满，但很多时候会显得急于解释和简化，略有堆砌，建议用作案头书备查

讲了整个巴塞尔许多大框架，但是很多细节并没有

厉害厉害

作为银行风险计量的入门书足够优秀，哪怕过去了近十年，里面的大部分理论仍在现实中应用或优化

对巴二框架体系做了较为完善的总结，书中有大量数理分析及实务操作，值得推荐。但由于涵盖内容过于广泛，所以很多细节并未展开讨论。推荐对风险管理有兴趣的读者阅读。

[商业银行风险计量理论与实务_下载链接1](#)

书评

对于全面风险管理在商业银行的具体落地实现有启发，适合银行从业人员，尤其是具有风险管理（熟悉全面风险管理、巴塞尔协议）、信息科技（数据库、机器学习、数理统计）复合背景的从业人员一读。不推荐学生、教师等偏理论学习的读者阅读。

[商业银行风险计量理论与实务_下载链接1](#)