

<<商业银行流动性风险度量方法>>

图书基本信息

书名：<<商业银行流动性风险度量方法>>

13位ISBN编号：9787509505854

10位ISBN编号：7509505852

出版时间：2008-4

出版时间：中国财政经济出版社

作者：金百锁等著

页数：185

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>

## <<商业银行流动性风险度量方法>>

### 内容概要

《商业银行流动性风险度量方法》改编自季敦民的博士论文《商业银行流动性风险衡量及相关问题研究》。

论文审核时，受到了巴曙松、黄泽民、徐伟宣、缪柏其、胡太忠五位教授较优的评价：“本文的选题不仅具有理论意义也具有很强的实际应用价值”，“作者找到了解决问题的有效方法，文中有大量具有说服力的实证研究”，“文章的研究成果对商业银行流动性风险管理具有积极的意义”，“能够将统计学中一些新的或有效的方法应用到流动性风险研究中去，收到了很好的成效，这也是本文的特色”，“从论文可以反映出作者对研究领域的文献资料有较为深入地了解，并已在本门学科上掌握了坚实宽广的基础理论和深入的专门知识”。

## <<商业银行流动性风险度量方法>>

### 书籍目录

导论第1章 商业银行流动性风险度量方法之综合评论1.1 引言1.2 巴塞尔委员会及各国银行流动性监管比较1.3 流动性管理理论的历史演变1.4 流动性风险的度量方法1.5 文献综述及最新发展状况1.6 西方国家央行对次贷引发的流动性危机的治理1.7 中国的现实状况1.8 小结第2章 商业银行流动性风险及最优资产配置2.1 基本模型2.2 资本市场对商业银行流动性风险的影响2.3 银行间市场对商业银行流动性风险的影响2.4 银行危机救助制度对商业银行流动性风险的影响第3章 利用广义随机占优思想度量商业银行流动性风险3.1 引言3.2 Copula3.3 广义随机占优与高阶ES测度3.4 数据来源及预处理3.5 模型原理及实证分析3.6 结论3.7 小结第4章 度量商业银行流动性风险的条件风险测度4.1 引言4.2 分位数自回归方法4.3 实证分析4.4 小结第5章 商业银行流动性缺口的统计扫描5.1 引言5.2 最长链统计量5.3 数据说明5.4 结论第6章 商业银行流动性风险影响因素分析6.1 引言6.2 灰色关联度分析6.3 非线性协整理论及其方法6.4 数据说明6.5 实证分析6.6 结论第7章 近年来货币政策调控流动性的效果检验7.1 引言7.2 变点理论及Copula的变点检测方法7.3 实证分析7.4 小结第8章 全球化视角下的流动性问题研究8.1 引言8.2 世界的流动性问题8.3 中国的流动性问题8.4 结论和未来展望结束语附录附录一：安徽省商业银行流动性供给与需求统计数据（1997-2006年）附录二：安徽省宏观经济统计数据（1997-2006年）参考文献

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>