

УДК 336.71(470+571)
ББК 65.053.526.2(Рос)
М24

РЕЦЕНЗЕНТЫ:

М.А. Поморина,

доктор экономических наук, профессор кафедры

«Банки и банковский менеджмент»

ФГБОУ ВПО «Финансовый университет

при Правительстве Российской Федерации»;

Ю.Ю. Русанов,

доктор экономических наук,

профессор кафедры «Банковское дело»

ФГБОУ ВПО «Российский экономический университет им.

Г.В. Плеханова»

Мануйленко, Виктория Валерьевна.

М24 Оценка экономического капитала банка в условиях развития интенсивной модели российского банковского сектора / В. В. Мануйленко. — 2-е изд., эл. — 1 файл pdf: 177 с. — Москва : Финансы и статистика, 2021. — Систем. требования: Adobe Reader XI либо Adobe Digital Editions 4.5 ; экран 10". — Текст: электронный.

ISBN 978-5-00184-048-0

Предложены альтернативные подходы к оценке экономического капитала кредитной организации в условиях формирования интенсивной модели российского банковского сектора. С учетом международного (Базель II, III) и национального опыта разработаны методики оценки экономического капитала по кредитному, рыночному, операционному рискам в интегрированной системе управления банковскими рисками, реализована риск-ориентированная концепция оценки эффективности экономического капитала. Осуществлена их практическая апробация в российских банках.

Для научных, банковских работников, преподавателей, аспирантов, магистров и студентов финансово-банковских направлений высших учебных заведений.

УДК 336.71(470+571)
ББК 65.053.526.2(Рос)

В соответствии со ст. 1299 и 1301 ГК РФ при устранении ограничений, установленных техническими средствами защиты авторских прав, правообладатель вправе требовать от нарушителя возмещения убытков или выплаты компенсации.

ISBN 978-5-00184-048-0

© ООО «Издательство
«Финансы и статистика», 2021

Оглавление

Введение	5
Глава 1. Формирование универсального подхода к оценке экономического капитала в интегрированной системе управления банковскими рисками: российская теория и практика.....	7
Глава 2. Методика определения экономического капитала банка по кредитному риску на основе имитационной модели ожидаемых потерь	29
Глава 3. Комбинированный подход к оценке экономического капитала банка по рыночному риску	50
Глава 4. Определение операционного экономического капитала банка в интегрированной системе управления операционным риском	65
Глава 5. Реализация риск-ориентированной концепции оценки эффективности экономического капитала в интегрированной системе управления банковскими рисками	88
Заключение	99
Приложения	101
Список использованных источников	167

Contents

Introduction.....	5
Chapter 1. The formation of a universal approach to the assessment of the economic capital in the integrated system of the management of banking risks: Russian theory and practice.....	7
Chapter 2. The methodology of determining the economic capital of the Bank to credit risk on the basis of a simulation model of expected losses	29
Chapter 3. The combined approach to the assessment of the economic capital of the Bank to market risk.....	50
Chapter 4. Definition of an operating economic capital of the Bank in the integrated system of operational risk management..	56
Chapter 5. Implementation of risk-oriented concepts in assessing the effectiveness of economic capital in the integrated system of the management of banking risks.....	88
Conclusion.....	99
Enclosure	101
References.....	167