

УДК 336.71(470+571)
ББК 65.053.526.2(2Рос)
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(2Рос)

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 |