

重尾性操作风险度量模型与管理模型的连接参数

莫建明,周宗放,贺炎林

收稿日期 修回日期 网络版发布日期 2010-12-8 接受日期

摘要 连接重尾性操作风险的度量模型与管理模型,以弹性分析方法对重尾性操作风险价值的灵敏度进行了理论分析,建立了操作风险关键管理参数的判别模型,并以示例验证了该模型的有效性。该关键管理参数将度量模型与管理模型连接起来,使操作风险管理框架成为一个完整体系,为建立操作风险动态管理系统奠定了基础。本研究在理论上完善了损失分布法在操作风险度量与管理中的应用。

关键词

分类号

DOI:

对应的英文版文章: [2009-1241](#)

通讯作者:

作者个人主页: 莫建明;周宗放;贺炎林

扩展功能

本文信息

▶ [Supporting info](#)

▶ [PDF](#) (202KB)

▶ [\[HTML全文\]](#) (0KB)

▶ [参考文献\[PDF\]](#)

▶ [参考文献](#)

服务与反馈

▶ [把本文推荐给朋友](#)

▶ [加入我的书架](#)

▶ [加入引用管理器](#)

▶ [引用本文](#)

▶ [Email Alert](#)

相关信息

▶ [本刊中 无 相关文章](#)

▶ 本文作者相关文章

· [莫建明](#)

· [周宗放](#)

· [贺炎林](#)