

Пересецкий, А. А. Эконометрические методы в дистанционном анализе деятельности российских банков [Текст] / А. А. Пересецкий ; Нац. исслед. ун-т «Высшая школа экономики». — М.: Изд. дом Высшей школы экономики, 2012.-235, [5] с.

Оглавление

ВВЕДЕНИЕ

ГЛАВА 1. Методы дистанционного анализа банков

- 1.1. Банковская система России. Банковский надзор
 - 1.1.1. Банковская система России
 - 1.1.2. Банковские рейтинги в России
 - 1.1.3. Базельское соглашение
 - 1.1.4. Система CAMEL(S)
- 1.2. Эконометрический подход к оценке рисков
 - 1.2.1. Системы раннего предупреждения (EWS)
 - 1.2.2. Эконометрические модели в дистанционных методах анализа состояния банков США
 - 1.2.3. Различные направления в дистанционном анализе
- 1.3. Актуальные проблемы дистанционного анализа

ГЛАВА 2. Эконометрические модели вероятности дефолтов банков

- 2.1. Введение и краткий обзор литературы
- 2.2. Помогает ли кластеризация
 - 2.2.1. Данные
 - 2.2.2. Модели и кластеры
 - 2.2.3. Экспертный подход
 - 2.2.4. Автоматическая классификация
- 2.3. Модели с учетом макроэкономического окружения

- 2.3.1. Данные
- 2.3.2. Модели с макроэкономическими показателями
- 2.3.3. Сравнение моделей: ошибки 1 и II рода
- 2.3.4. Сравнение моделей: эвристические критерии
- 2.4. После кризиса
- 2.5. Заключение

ГЛАВА 3. Эконометрическое моделирование рейтингов банков

- 3.1. Введение
 - 3.1.1. Роль рейтингов
 - 3.1.2. Моделирование рейтингов
- 3.2. Рейтинги российских агентств и экспертов
 - 3.2.1. Введение
 - 3.2.2. Данные и модели
 - 3.2.3. Анализ существующих рейтингов
 - 3.2.4. Анализ данных опроса экспертов
 - 3.2.5. Модельные рейтинги банков
 - 3.2.6. Выводы
- 3.3. Рейтинги международного рейтингового агентства Moody s
 - 3.3.1. Международные рейтинговые агентства в России
 - 3.3.2. Данные
 - 3.3.3. Модели РД и РФУБ
 - 3.3.4. Модели факторов внешней поддержки банка
 - 3.3.5. Оценки точности моделей рейтингов

3.3.6. Метод прогноза некоторых макроэкономических
показателей

3.4. Заключение

ГЛАВА 4. Модели процентных ставок

4.1. Введение

4.2. Модели с квартальными данными

4.2.1. Данные

4.2.2. Модели процентных ставок. Рыночная дисциплина

4.2.3. Процентные ставки и страхование депозитов

4.2.4. Выводы

4.3. Модели с ежемесячными данными

4.3.1. Данные

4.3.2. Модели и результаты

4.3.3. Выводы

4.4. Заключение

ГЛАВА 5. Модели эффективности банков по издержкам

5.1. Введение

5.1.1. Эффективность и надежность

5.1.2. Различные подходы к оценке технической
эффективности

5.2. **Российские банки**

5.2.1. Данные

5.2.2. Модели

5.2.3. Результаты

5.3. Эффективность банков России и Казахстана

5.3.1. Банковские системы России и Казахстана

5.3.2. Данные

5.3.3. Модели эффективности по издержкам

5.3.4. Результаты

5.4. Заключение

Выводы

Приложения

а. Графики к главе 2

в. Материалы к главе 3

с. Таблицы к главе 4

Литература