

Петрова, Юлия Игоревна.

Статистические методы принятия решений по стабилизации стратегических позиций иностранной кредитной организации на российском кредитном рынке : монография / Ю.И. Петрова, В.Е. Рассказов, В.Н. Салин, В.Т. Севрук. - Москва : КНОРУС, 2017,- 160 с.

СОДЕРЖАНИЕ

АВТОРСКИЙ КОЛЛЕКТИВ.....	7
ВВЕДЕНИЕ.....	8
1. ОБОСНОВАННЫЙ НАБОР ПОКАЗАТЕЛЕЙ, ХАРАКТЕРИЗУЮЩИХ РИСКИ РОССИЙСКОГО КРЕДИТНОГО РЫНКА, ДЛЯ ОЦЕНКИ ЭФФЕКТИВНОСТИ ДЕЯТЕЛЬНОСТИ БАНКА.....	11
1.1. Характеристика основных банковских рисков.....	11
1.2. Показатели оценки финансовой стабильности банков.....	27
1.3. Показатели, характеризующие финансовую стабильность российских заемщиков.....	43
2. ФОРМИРОВАНИЕ БЛОКА СТАТИСТИЧЕСКИХ МЕТОДОВ ДЛЯ АДЕКВАТНОЙ ОЦЕНКИ ДЕЯТЕЛЬНОСТИ БАНКА «САНТАНДЕР» И ПРИНЯТИЯ ИМ ЭФФЕКТИВНЫХ УПРАВЛЕНЧЕСКИХ РЕШЕНИЙ.....	59
2.1. Методы оценки кредитного риска, используемые финансовыми учреждениями.....	59
2.2. Использование метода стресс-тестирования для измерения влияния рыночных шоков на финансовую стабильность банков.....	77
3. МЕТОДИКА РАСЧЕТА И ИНТЕРПРЕТАЦИЯ ПОЛУЧЕННЫХ РЕЗУЛЬТАТОВ НА ОСНОВЕ МОДЕЛИ NUI-NEUBEL.....	88
3.1. Построение моделей оценки системного риска.....	88
3.2. Процессы стратегического прогнозирования системных рисков.....	99
ЗАКЛЮЧЕНИЕ.....	104
СПИСОК ИСПОЛЬЗОВАННЫХ ИСТОЧНИКОВ.....	111
ПРИЛОЖЕНИЯ.....	115
Приложение 1 Индикаторы текущего финансового состояния.....	115
Приложение 2 Сопоставление ПФУ по методикам МВФ и ЦБ РФ.....	119

Приложение 3	
Сопоставление ПФУ по методикам МВФ и ЦБ РФ (рекомендуемый перечень).....	122
Приложение 4	
Анализ структуры обязательств (привлеченных средств)	125
Приложение 5	
Подходы и модели оценки основных рисков в целях стресс-тестирования.....	128
Приложение 6	
Основные финансовые показатели, подвергающиеся стресс-тестированию.....	130
Приложение 7	
Уровни выполнения банками стресс-тестирования	132