

## 重尾性操作风险的风险价值置信区间的灵敏度

莫建明, 周宗放

收稿日期 修回日期 网络版发布日期 接受日期

### 摘要

根据操作风险价值不确定度的合成机理,通过对重尾性操作风险价值解析解的分析,导出高置信度下重尾性操作风险价值的标准不确定度及置信区间.进而以弹性分析方法对该置信区间的灵敏度进行理论探讨和实例分析后发现:随尾指数的增大,操作风险价值及其置信区间长度同时增大,且在高置信度下,尾指数是影响操作风险价值及其置信区间长度灵敏度的关键参数.据此,可将尾指数作为操作风险的监控参数,操作风险监控资本的提取方式可改进为:以操作风险价值的某一置信区间为监管资本的控制范围.这在理论上进一步完善了损失分布法在操作风险度量中的应用,并使操作风险的管理更加合理.

关键词 [操作风险](#) [操作风险价值的置信区间](#) [不确定性传递理论](#) [弹性理论](#)

分类号

DOI:

对应的英文版文章: [2009060059](#)

通讯作者:

作者个人主页: 莫建明;周宗放

### 扩展功能

本文信息

▶ [Supporting info](#)

▶ [PDF](#)(470KB)

▶ [\[HTML全文\]](#)(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 包含“操作风险”的 相关文章](#)

▶ 本文作者相关文章

· [莫建明](#)

· [周宗放](#)