第一图书网, tushu007.com

<<风险管理与金融机构>>

图书基本信息

书名：<<风险管理与金融机构>>

13位ISBN编号：9787111226956

10位ISBN编号：711122695X

出版时间：2007-1

出版时间：机械工业出版社

作者：[加]约翰*赫尔

页数：308

版权说明：本站所提供下载的PDF图书仅提供预览和简介，请支持正版图书。

更多资源请访问：http://www.tushu007.com

内容概要

本书侧重讲述银行和其他金融机构所面临的风险。
首先从风险与回报的替代关系入手，逐步深入地讨论了市场风险、信用风险和操作风险等。
在讨论基础风险类型的同时也花了大篇幅讨论《新巴塞尔协议》，并列举了近年来发生在金融界的重大损失案例。
章后练习题和作业题帮助学生进一步理解概念、掌握操作程序及流程。

本书可作为高等院校金融相关专业的教材，也适用于金融交易和风险管理相关从业人员的参考用书。

作者简介

约翰·赫尔，衍生产品和风险管理教授，在衍生产品和风险管理领域享有盛名，研究领域包括信用风险、经理股票期权，波动率曲面市场风险以及利率衍生产品。
他和艾伦·怀特（Alan
White）教授研发出的赫尔·怀特（Hull—White）利率模型荣获Nikko—LOR大奖。
他曾为北美、日本和欧

书籍目录

致中国读者
推荐序
译者序
作者简介
译者简介
前言
第1章 导言
1.1 投资人的风险与回报的关系
1.2 公司的风险及回报
1.3 银行资本
1.4 管理风险手段
1.5 净利息收入管理
1.6 小结
推荐阅读
练习题
作业题
第2章 金融产品和风险对冲
2.1 市场
2.2 何时进行对冲
2.3 简单产品
2.4 应用衍生产品来进行对冲
2.5 特种期权和结构性产品
2.6 危害
2.7 小结
推荐阅读
练习题
作业题
第3章 交易员如何管理风险暴露
3.1 Delta
3.2 Gamma
3.3 Vega
3.4 Theta
3.5 Rho
3.6 希腊值的计算
3.7 泰勒级数展开
3.8 对冲的现实状况
3.9 特种产品对冲
3.10 情形分析
3.11 小结
推荐阅读
练习题
作业题
第4章 利率风险
4.1 利率的计量
4.2 零息利率和远期利率

4.3 国债收益率
4.4 伦敦银行同业拆借利率和互换利率
4.5 久期
4.6 曲率
4.7 久期和曲率在交易组合中的应用
……
第5章 波动率
第6章 相关系数与Copula函数
第7章 银行管理条约和《新巴塞尔协议》
第8章 VaR测度
第9章 市场风险：历史模拟法
第10章 市场风险：模型构建法
第11章 信用风险：估测违约概率
第12章 信用风险损失和信用风险价值度
第13章 信用衍生产品
第14章 操作风险
第15章 模型风险和流通性风险
第16章 经济资本金与RAROC
第17章 天气、能源和保险衍生产品
第18章 重大金融损失和借鉴意义
附录A 远期合约和期货合约的定价
附录B 互换合约定价
附录C 欧式期权定价
附录D 美式期权定价
附录E 对信用转移矩阵的处理
练习题答案
术语表
DerivaGem软件说明
x≤0时N（x）的取值
x≥0时N（x）的取值

编辑推荐

其它版本请见：《风险管理与金融机构（原书第2版）》

第一图书网, tushu007.com

版权说明

本站所提供下载的PDF图书仅提供预览和简介，请支持正版图书。

更多资源请访问:http://www.tushu007.com