第一图书网, tushu007.com

<<金融风险管理师考试手册>>

图书基本信息

书名：<<金融风险管理师考试手册>>

13位ISBN编号：9787300131726

10位ISBN编号：7300131727

出版时间：2011-2

出版时间：中国人民大学

作者：菲利普·乔瑞

页数：616

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

致力于获得金融风险管理师(FRM)认证的风险管理专业人员都用本书来学习和更新关于金融风险管理的综合信息。

本书具有深远和务实的见解，是世界范围内风险管理培训项目的核心手册。
它帮助考生准备全球风险专业协会(GARe)的FRM考试，这是衡量金融风险管理标准的全球性考试，同时还能帮助考生在当今急速变化的金融世界中评估和控制风险。
本书由风险管理专家菲利普．乔瑞撰写，并且得到了GARP的全力支持。
本书把金融风险管理者们的核心知识架构概括如下：
市场，信用，操作，流动性和整体风险管理
数量分析方法
资本市场
投资管理和对冲基金风险
与风险管理相关的监管和法律问题
FRM被认为是世界上最具声望的衡量金融风险管理能力的全球性认证。
由于FRM考试是世界范围内风险管理者的基本要求，本书致力于金融风险管理的实务技术以及解决问题的方法，这在实际中相当重要。
通过以前考试题目的解析，考生可以准备FRM考试并且迎接在职业生涯中肯定将面对的风险?理挑战。

作者简介

菲利普·乔瑞，芝加哥大学MBA、博士，比利时布鲁塞尔大学工学学士。
现为州大学欧文分校金融学教授，曾执教哥伦比亚大学和西北大学。
主要研究领域为风险管理、国际金融、全球资产配置和固定收益证券市场。
乔瑞博士已经发表了70多篇文章，主题涉及风险管理和国际金融领域的学术和实务。
他是《风险杂志》的主编，也是一些金融杂志的编委会成员。
他曾获得史密斯·布里登研究奖和威廉·夏普金融研究学术奖。

第一图书网, tushu007.com

<<金融风险管理师考试手册>>

书籍目录

第1部分　数量分析
第1章 债券的基本原理
1.1 折现、现值和终值
1.2 价格一收益率关系
1.3 债券价格的导数
1.4 重要公式
1.5 例题解答
第2章 概率论基础
2.1 刻画随机变量
2.2 多元分布函数
2.3 随机变量函数
2.4 重要的分布函数
2.5 极限分布
2.6 重要公式
2.7 例题解答
第3章 统计学基础
3.1 现实数据
3.2 参数估计
3.3 回归分析
3.4 重要公式
3.5 例题解答
第4章 蒙特卡洛方法
4.1 随机变量的模拟
4.2 模拟实现
4.3 风险的多种来源
4.4 重要公式
4.5 例题解答
第2部分　资本市场
第5章 衍生产品介绍
5.1 衍生产品市场综述
5.2 远期合约
5.3 期货合约
5.4 互换合约
5.5 重要公式
5.6 例题解答
第6章 期权
6.1　期权收益
6.2 期权费
6.3　期权定价
6.4　其他类型期权
6.5　利用数值方法对期权定价
6.6　重要公式
6.7　例题解答
第7章 固?收益证券
7.1 债务市场概述

7.2 固定收益证券
7.3 固定收益证券分析
7.4 即期和远期利率
7.5 提前偿付
7.6 证券化
7.7 重要公式
7.8 例题解答
第8章 固定收益衍生品
8.1 远期合约
8.2 期货
……
第3部分 市场风险管理
第4部分 投资风险管理
第5部分 信用风险管理
第6部分 法律、操作和全面风险管理
第7部分 监管与法规

编辑推荐

同名英文原版书火热销售中：Financial Risk Manager Handbook

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