第一图书网, tushu007.com

<<金融风险管理>>

图书基本信息

书名：<<金融风险管理>>

13位ISBN编号：9787309066739

10位ISBN编号：7309066731

出版时间：2009-6

出版时间：复旦大学出版社

作者：张金清

页数：323

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

前言

人类的恐惧常常来自无知，但无知带来的恐惧却并不一定最可怕，最可怕的往往是建立在一知半解基础上的管理漏洞和贸然行动，尤其是贸然行动后一次或几次的侥幸成功将有可能导致对管理漏洞和潜在风险的更加熟视无睹以及更进一步的行为冒进。
其实道理并不复杂，因为基于无知的恐惧往往会使得人们的行为趋于谨慎、保守，而与管理漏洞和贸然行动相比，谨慎和保守的行为有可能丧失一些成功的机会，但还不至于招致颠覆性的损失，甚至危机。
这样的故事和经历几乎在每个国家、每个地区的每个领域都曾上演过，在经济金融领域，尤其在金融风险度量与管理方面更是如此。
目前正在上演的、起因于美国次贷危机、被前美联储主席格林斯潘认为是“百年一遇”的全球性金融风暴，很大程度上就是由于各类投资机构普遍对次贷衍生品的风险生成与传导机制一知半解或漠视而采取的连续大规模的贸然行动所引发的。
这场风暴，就连曾经令无数世人神往、声名远播的华尔街也遭受了前所未有的重创：华尔街上五大投行中的贝尔斯登、雷曼兄弟、美林三大投行相继倒下，高盛和摩根斯坦利两大投行也不得不变身为银行控股公司，至此，华尔街前五大投行尽数沉没。
与此同时，世界经济也备受牵连。
即使远离美国的中国投资者，也感受到了从遥远的大洋彼岸吹来的其实已经减弱很多但依然凛冽入骨的“寒风”。

内容概要

《金融风险管理》首先详细讨论和界定了有关金融风险及其所包含的各类主要风险的定义、特性等一些基本概念和基本知识，在此基础上全面、系统、深入地介绍、阐释、分析了各类金融风险的辨识理论、方法以及市场风险、信用风险、操作风险和流动性风险这四类主要风险的各种度量理论、方法与技术。
另外，《金融风险管理》还涉及到了上述四类金融风险度量理论和方法的历史演变以及经典的VaR方法，等等。
《金融风险管理》可作为经济、金融、管理类的教师、研究人员、高年级本科生和研究生以及实践领域的金融工作者的教材或参考书。

<<金融风险管理>>

书籍目录

第一章 金融风险的基本概念解析第一节 金融风险的定义及特性分析一、金融风险的概念二、金融风险的特点三、金融风险的来源分析四、金融风险的经济结果分析五、金融风险与未预期损失、经济资本、监管资本等概念之间的关系第二节 金融风险的分类第三节 金融市场风险引例基于三个典型案例对金融市场风险的认识一、市场风险的定义与特性二、市场风险的分类第四节 信用风险引例基于百富勤倒闭事件对信用风险的认识一、信用风险的概念二、信用风险的分类三、信用风险与市场风险的区别与联系第五节 操作风险引例基于巴林银行事件对操作风险的认识一、操作风险的概念二、操作风险的基本特性三、操作风险的分类第六节 流动性风险引例基于美国大陆伊利诺银行流动性危机对流动性风险的认识一、流动性风险的概念二、流动性风险的成因与特性分析三、流动性风险的分类第七节 其他类型的金融风险一、经营风险二、国家风险三、关联风险第二章 金融风险辨识第一节 金融风险辨识的概念和原则一、金融风险辨识的概念二、金融风险辨识的原则三、金融风险辨识的作用第二节 金融风险辨识的基本内容一、金融风险类型和受险部位的识别二、金融风险诱因和严重程度的辨识第三节 风险辨识的基本方法一、现场调查法二、问卷调查法三、组织结构图示法四、流程图法五、专家调查法六、主观风险测定法七、客观风险测定法八、幕景分析法九、模糊集合分析法十、故障树分析法十一、其他方法简述十二、金融风险辨识方法评述第三章 金融市场风险的度量第一节 金融市场风险度量方法的演变一、名义值度量法二、灵敏度方法三、波动性方法四、VaR方法五、压力试验和极值理论六、集成风险或综合风险度量第二节 灵敏度方法一、简单缺口模型二、到期日缺口模型或利率敏感性缺口模型三、久期、凸性与缺口模型四、B系数和风险因子敏感系数五、金融衍生品的灵敏度测量六、灵敏度度量法评述第三节 波动性方法一、单种资产风险的度量二、资产组合风险的度量三、特征风险、系统性风险与风险分散化四、波动性方法的优缺点评述第四节 VaR方法一、VaR方法的基本概念二、VaR的计算三、边际VaR、增量VaR和成分VaR四、VaR方法的优缺点评述第五节 基于历史模拟法的VaR计算一、基于标准历史模拟法计算VaR的基本原理和实施步骤引例基于标准历史模拟法的VaR计算举例二、计算VaR的标准历史模拟法的评述三、计算VaR的标准历史模拟法的修正及扩展第六节 基于Monte Carlo模拟法的VaR计算一、MonteCarlo模拟法二、基于Monte Carlo模拟法的计算VaR的基本步骤三、基于Monte Carlo模拟法计算VaR的应用举例四、基于Monte Carlo模拟法VaR计算的评述五、Monte Carlo模拟法的改进与扩展介绍第七节 基于Delta、Gamma灵敏度指标的VaR计算一、基于Delta类方法的VaR计算二、基于Delta-Gamma类方法的VaR计算三、基于Hull-white正态变换方法的VaR计算第八节 厚尾分布事件中的市场风险度量——压力试验和极值理论一、压力试验引例系统化压力试验举例二、极值理论引例利用POT模型计算VaR举例第四章 信用风险的度量第五章 操作风险的度量第六章 流动性风险的度量附录经济学和金融学中的随机理论初步参考文献

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