<<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：9787560535159

10位ISBN编号：7560535151

出版时间：2011-4

出版时间：西安交通大学出版社

作者：冯宗宪 编

页数：439

字数：524000

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>

<<金融风险管理>>

内容概要

《金融风险管理》是作者冯宗宪在多年从事金融风险管理教学和研究的基础上，为适应研究生教学需要而编著的教材。

全书结合现代金融风险理论、方法和案例分析为一体，融合定性分析与定量分析，不仅详细阐述了金融风险管理的沿革和有关理论与政策发展，而且对风险管理规则和政策方面的研究内容和成果也尽可能进行了系统的介绍，同时还着重对当前金融风险管理领域，如信用风险、市场风险、操作风险、利率风险以及汇率风险等领域，进行了应用分析和案例讨论。

书籍目录

第1章导论

- 1.1金融风险的定义及分类
- 1.2金融风险管理的产生及其理论基础
- 1.3金融风险管理的步骤和风险测度
- 1.4金融风险管理所面临的挑战和发展趋势
- 1.5本书的结构和内容安排

第2章金融市场及其风险

- 2.1金融市场的基本概念和金融市场体系
- 2.2货币市场与风险
- 2.3外汇市场及其风险
- 2.4固定收益证券与风险
- 2.5股票市场及其风险
- 2.6资产证券化及其风险
- 2.7金融衍生产品市场
- 2.8金融衍生产品的风险

第3章金融风险监管机构与风险监管

- 3.1金融风险监管与机构
- 3.2国际金融监管机构
- 3.3巴塞尔新资本协议
- 3.4资产证券化风险监管
- 3.5巴塞尔新资本协议的实施
- 3.6金融危机对监管规则的新挑战
- 3.7金融体系稳健性的评估

第4章风险评级

- 4.1个人信用评级
- 4.2证券评级
- 4.3基金风险评级
- 4.4对金融机构的评级
- 4.5国家风险评级

第5章信用风险管理

- 5.1信用风险及其评估
- 5.2新资本协议内部评级法
- 5.3信用等级转移矩阵
- 5.4信用风险度量模型
- 5.5信用风险转移
- 5.6压力测试

第6章市场风险管理

- 6.1市场风险度量简介
- 6.2常用的市场风险度量方法
- 6.3VaR系统

第7章操作风险管理

- 7.1操作风险概述
- 7.2操作流程架构和规则
- 7.3操作风险评估

第8章利率风险管理

<<金融风险管理>>

- 8.1利率风险
- 8.2市场基准利率
- 8.3收益率曲线及其特征
- 8.4利率风险的度量方法
- 8.5利率期限结构的理论和模型
- 8.6信用价差
- 第9章汇率风险管理
- 9.1汇率风险的界定及成因
- 9.2汇率风险敞口计量方法
- 9.3汇率风险管理工具
- 9.4VaR理论模型在汇率风险管理中的应用
- 9.5压力测试案例分析
- 第10章贷款综合风险定价
- 10.1商业银行经济资本的计量
- 10.2RAROC基本原理
- 10.3RAROC贷款定价方法及应用
- 第11章衍生品定价与风险管理
- 11.1衍生品定价理论
- 11.2远期合同约定价的一般理论
- 11.3期货定价
- 11.4期权与期权定价
- 11.5常用的期权定价方法
- 11.6信用衍生品交易
- 11.7互换与信用衍生品定价及风险管理
- 附录
- 附录
- 参考文献
- 后记

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>