第一图书网, tushu007.com

<<证券市场的风险控制>>

图书基本信息

书名：<<证券市场的风险控制>>

13位ISBN编号：9787564203795

10位ISBN编号：756420379X

出版时间：2009-3

出版时间：上海财经大学出版社有限公司

作者：徐士敏

页数：309

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

证券市场是现代经济的重要组成部分，是市场经济资源配置的重要途径。
在现代市场经济中，随着证券化程度的不断提高，证券市场在社会经济中发挥作用的范围和程度也日益扩大和提高。
在建立社会主义市场经济的进程中，我国证券市场按照法制、监管、自律、规范的指导方针，从无到有，从小到大，从区域到全国，迅速发展，在短短的十余年取得了举世瞩目的成就。
当前我国证券市场正处于由探索阶段到规范阶段的转折时期。
在这个时期，证券公司作为证券市场的主要中介机构和参与主体，其规范运作的重要意义不言而喻。
然而，规范必须要有监督。
毋庸讳言，现阶段证券公司的自律能力还有待于提高，内部监督还是一个薄弱环节，亟待强化和完善；与此同时，还须加强外部监管。
众所周知，证券市场是商品经济、信用经济高度发展的产物，是市场经济中一种高级组织形态。
证券市场又是高风险市场，这是因为证券价格具有很大的波动性和不确定性。
这是由证券的本质及市场运作的复杂性所决定的。
同成熟市场相比，我国证券市场起步晚，还处于初级阶段，上市公司、证券公司等市场参与者的素质有待提高，投资者风险意识相对薄弱，监管手段有待完善，管理市场的经验还不成熟，市场所隐含的风险更大。
因此，我们必须充分认识防范和控制市场风险的必要性，把风险防范与控制当作市场建设过程中常抓不懈的重要工作。
所有的市场参与者都要充分认识到这一点：风险防范，警钟长鸣。

第一图书网, tushu007.com

内容概要

证券市场风险管理丛书试图从证券市场的风险控制、证券公司的风险管理、海外券商的风险控制等几个部分，全面简述证券市场的风险管理问题。
本丛书可供培训证券从业人员之用，同时也可提供证券公司管理人员、监管部门工作人员和财经院校师生学习参考。
本书为该系列丛书之一，从证券市场的风险控制这一角度入手。

<<证券市场的风险控制>>

书籍目录

第一章 投资风险的五大特征 第一节 长期存在的永恒性 第二节 不易察觉的隐蔽性 第三节 随时可降的突发性 第四节 相互牵扯的连锁性 第五节 结局惨重的灾难性第二章 中国金融的风险现状 第一节 中国金融体系中的风险状况 第二节 制度缺陷下中国金融市场的系统风险 第三节 金融体系不稳定因素存在潜增的可能 第四节 风险控制日益受到证券市场重视第三章 剖析十大风险案例 第一节 发人深省的十大风险案例 第二节 中国业界的反省与思考 第三节 金融危机中的管理之道第四章 证券市场的风险管理 第一节 中国证券市场的特殊风险 第二节 建立有效的风险管理系统 第三节 防止券商风险演化为公共风险 第四节 证券市场监管任重道远第五章 证券市场的各类风险及其成因 第一节 证券市场的各类风险 第二节 证券市场的风险成因 第三节 股市泡沫与流动性过剩第六章 证券结算的风险控制 第一节 证券结算风险不容忽视 第二节 结算风险的主要表现 第三节 证券结算系统风险控制与管理 第四节 加强结算风险控制已成当务之急第七章 中国证券市场风险分析及定量风险管理体系 第一节 中国证券市场风险分析 第二节 VaR风险管理理论简介 第三节 建立定量风险管理体系，控制证券市场风险第八章 防范道德风险是核心问题 第一节 道德风险的危害与表现 第二节 证券金融从业人员道德风险的防范 第三节 加强道德风险的防范 第四节 阻断风险链是关键所在第九章 强化信息技术的风险管理 第一节 全球计算机安全问题应引起更多注意 第二节 网络犯罪及其对策 第三节 强化证券市场电脑通信系统的管理 第四节 确保证券公司电脑通信系统的安全运行第十章 突发公共事件的风险管理 第一节 突发公共事件的严峻挑战 第二节 证券市场应对突发事件的经验和教训 第三节 近年来世界证券市场的突发事件回顾 第四节 建立我国证券市场突发事件应对机制第十一章 证券市场的制度性缺陷不容忽视 第一节 中国证券市场的系统性制度缺陷 第二节 中国股市“制度性”缺陷的成因 第三节 证券市场制度性缺陷犹存 第四节 中国资本市场境外化现象不容忽视参考资料

章节摘录

第一章 投资风险的五大特征　　所谓投资风险是指由不确定性所带来的收益减少的可能性，也就是说，投资风险是指投资的预期收益不实现的可能性。
英文中有两个单词：Risk和Exposure，常被译为风险。
Risk强调外在环境中所包含的不确定性，而Exposure则强调主体暴露于客观环境中存在的Risk的程度，因而又被译为暴露，但也常被译为风险。
既然风险是指可能性，风险的大小也就是可能性的大小。
然而，风险的大小与风险可能带来的损失程度无关。
这只要看一下蒙受较小损失的投资者，远远多于蒙受重大损失的投资者就清楚了。
　　在明确了投资风险的含义后，再来认识一下投资风险的特征，即长期存在的永恒性、不易察觉的隐蔽性、随时可降的突发性、相互牵扯的连锁性、结局惨重的灾难性。
这也许有助于我们进一步提高风险意识。
以下我们就投资风险的五大特征，分别加以说明。
　　第一节 长期存在的永恒性　　国际证券结算资深专家、G-30小组成员、美国证券结算公司（NSCC）总裁厄·丹尼斯（Dennis M．Corle）先生曾说过：“只有不进行交易的市场才不产生风险。”这说明了证券市场本身就蕴含着风险。
并且，高收益往往伴随着高风险，正像一对孪生兄弟一样。

编辑推荐

撰写《证券市场的风险控制》是一个新的尝试，由于参考资料缺乏，专业水平有限，缺点与错误在所难免，再加上近年来证券业务发展迅速，相关的规章制度变化较大，帮给写作带来一定的难度。为此热忱希望各界有识之士批评指正。

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