

<<风险管理（第9辑）>>

图书基本信息

书名：<<风险管理（第9辑）>>

13位ISBN编号：9787802557468

10位ISBN编号：7802557461

出版时间：2010-12

出版时间：中国金融风险经理论坛组委会 企业管理出版社 (2010-12出版)

作者：中国金融风险经理论坛组委会 编

页数：180

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>

<<风险管理（第9辑）>>

内容概要

《风险管理（第9辑·总）（2010年专题4）》秉承中国金融风险经理论坛的一贯精神和原则，扩展和延伸风险管理技术交流平台，进一步促进中国风险经理之间的交流和现代风险管理理念，制度和科技方法在中国的广泛传播。

《风险管理（第9辑·总）（2010年专题4）》的第9辑，包括：专业评论、专题访谈、主题风险、风险科技、理论研究、风险学苑等栏目。

## 书籍目录

中国金融风险研究回顾(2000~2010)卷首语新时期我国金融机构风险管理发展三大挑战——从“零风险经营”到“经营风险”的未完变革研究文献综述中国金融风险研究综述精选论文概要风险管理机制建设试论商业银行风险管理新兴加转轨条件下中国证券公司的风险成因及监控论在规范商业银行公司治理中推进风险管理改革商业银行全面风险管理体系及其在我国的构建金融机构风险管理机制有效性研究——对风险管理长效机制问题的思考风险管理中介的结构和定位：一个动态性模型论风险限额管理体系的构建和应用内部控制、对冲和经济资本配置——金融机构风险管理现代机制的整体框架银行公司治理与风险管理论商业银行风险容忍度管理试论风险偏好与银行的科学发展试论当前我国商业银行实施全面风险管理的组织架构主动选择风险与积极安排风险系统性金融风险研究：演进、成因与监管市场风险VaR体系与现代金融机构的风险管理利率市场化进程中的利率风险管理试论银行市场风险的监管中国银行间市场双边传染的风险估测及其系统性特征分析基于实现极差和实现波动率的中国金融市场风险测度研究论银行市场风险的资本计提——兼评内部模型法的适用性信用风险信用风险量化管理模型发展的探析财务杠杆、信号博弈与信用风险识别用期权定价原理分析抵押贷款的信用风险违约损失率(LGD)研究中国银行业不良资产证券化信用风险评价研究基于判别分析和logistic回归分析的城市商业银行信用风险度量积极推动零售信贷业务内部评级法建设我国银行小企业信贷模式与风险管理研究——基于银行问卷调查的分析违约损失率模型开发的理论分析和实证研究集中度风险管理：问题与防范操作风险银行操作风险计量与管理综合模型研究建立和完善防范操作风险的长效管理机制激励缺失与内部人道德风险——关于商业银行操作风险的问卷调查与思考保险在商业银行操作风险管理中的应用研究操作风险损失分类的原理与方法探讨商业银行操作风险管理框架评价研究中国银行业不良资产证券化信用风险评价研究现代金融机构操作风险管理研究流动性风险中国股市流动性风险测度研究VaR模型中流动性风险的度量基于Copula的开放式基金流动性风险研究中小银行流动性风险管理研究流动性风险管理新规及其挑战经济资本和巴塞尔资本监管新巴塞尔协议的风险新理念与我国国有商业银行全面风险管理体系的构建巴塞尔新资本协议框架下的操作风险衡量与资本金约束巴塞尔新资本协议框架中的市场约束论新巴塞尔资本协议与我国银行资本充足水平风险的国际协议与国际协议的风险——评巴塞尔新资本协议正式出台关于新资本协议中信用评级若干问题的探讨风险、风险资本与风险偏好资产证券化的资本充足率框架及其对我国的启示风险调整后的资本收益率在我国商业银行信用风险管理中的应用研究银行风险管理脱胎换骨的一次革命打开内部评级法的黑箱：假设、模拟与监管实践商业银行经济资本配置——理论模型与案例研究中国商业银行资本监管：制度变迁和效果评价从商业银行信用风险管理前瞻性理念看新资本协议内部评级违约定义实施精选图书介绍《风险——收益决策分析》《金融风险分析与管理研究——市场和机构的理论、模型与技术》《金融风险论》《金融市场风险管理》《现代银行全面风险管理》《银行业风险评估理论模型与实证》《巴塞尔新资本协议研究》《风险·资本·市值——中国商业银行实现飞跃的核心问题》《新巴塞尔资本协议与现代银行风险管理知识问答》《银行内部模型和监管模型——风险计量与资本分配》《银行信用风险——理论、模型和实证分析》《内部评级理论、方法与实务——巴塞尔新资本协议核心技术》《商业银行风险管理通论》《银行全面风险管理体系》《Basel 在中资银行的实践》《金融机构现代风险管理基本框架》《整合进行时——企业全面风险管理路线图》《中国银行业风险控制和资本充足性管制研究》《信贷风险管理》《资本约束与信贷扩张——兼论资本充足率监管的宏观经济效应》《商业银行经济资本配置与管理》《商业银行信用风险管理——兼论巴塞尔新资本协议》《商业银行压力测试》英文目录

章节摘录

版权页：插图：一、对风险与风险管理的认识近十多年来，中国金融业处于由计划体制向市场体制转型的关键时期，金融机构也正在经历着一场从公司治理和组织架构到业务流程和管理工具的全面而深刻的制度和技术变革。

在这场未完的变革中，从20世纪90年代流行一时的“金融机构零风险经营”到21世纪被广为接受的“金融机构是经营和管理风险的机构”中，我们不难看出，风险观念的转变是一切制度和技术变革的基础。

这一时期的文献研究也反映出对风险和风险管理的认识的转变和深化。

魏灿秋（2004）指出由于商业银行经营风险的不对称性（即商业银行的资产风险较大，而负债的偿还具有硬约束），风险管理已成为了商业银行经营管理的核心问题。

陈小宪（2004）指出，中外银行间的竞争是多层次、全方位的，但归根结底仍然是风险管理水平上的竞争；风险管理上的差距，是中国商业银行的最大差距，也是中国商业银行整体竞争力和盈利能力不强的根本原因。

魏国雄（2008）指出，商业银行如何在目前这种复杂、严峻的经济形势下继续控制好经营风险是当前商业银行面临的最大挑战。

朱小黄（2008）认为，实施新巴塞尔资本协议带来银行整个风险管理体系脱胎换骨的革命。

<<风险管理（第9辑）>>

编辑推荐

《风险管理(第9辑·总)(2010年专题4)》：研究文献综述、精选论文概要、精选图书介绍。

<<风险管理（第9辑）>>

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>