

金融风险度量与管理



[金融风险度量与管理_下载链接1](#)

著者:周晔

出版者:首都经贸

出版时间:2010-12

装帧:

isbn:9787563818693

《金融风险度量与管理》内容简介：金融风险是金融活动的内在属性，它的广泛存在是现代金融市场的重要特征。自中国加入世界贸易组织以来，金融业逐步对外开放，金融市场化不断提速。随着利率市场化、资本市场开放和人民币汇率管制逐步放松等诸多金

融改革的稳步推进，金融产品价格的波动性不断增强，国内金融机构面临着诸多风险。金融风险不仅严重影响了金融机构和工商企业的正常运营，而且随着我国经济全球影响力的快速增长，对我国乃至全球金融与经济的稳定构成了严重的威胁。

作者介绍:

目录: 第一章 金融风险管理概述 第一节 金融风险及其分类 第二节 金融风险管理 第三节 中国金融业的风险管理第二章 市场风险度量 第一节 市场风险度量简介 第二节 VAR的各种度量方法 第三节 投资组合风险的VAR度量 第四节 运用VAR进行市场风险的度量与控制第三章 利率风险度量与管理 第一节 利率风险简介 第二节 传统利率风险的管理方法 第三节 基于久期和凸性的利率风险免疫 第四节 应用衍生金融工具管理利率风险第四章 传统信用风险度量方法 第一节 古典信用风险度量方法 第二节 信用评级第五章 现代信用风险度量模型 第一节 信用等级转移分析与信用等级转移概率的计算 第二节 基于信用等级转移的CreditMetrics模型和Credit Portfolio View模型 第三节 KMV模型 第四节 CreditRisk+模型第六章 操作风险的度量与管理 第一节 巴塞尔协议 II 与操作风险 第二节 操作风险度量方法及其应用分析 第三节 银行操作风险管理的发展第七章 流动性风险度量与管理 第一节 流动性风险及其管理理论简介 第二节 流动性风险的度量及其管理方法 第三节 国际银行业流动性风险管理实践第八章 巴塞尔协议与资本充足率 第一节 巴塞尔协议 II 及其影响 第二节 资本与风险资产比率的计算 第三节 市场风险资本充足率的度量第九章 以风险为核心的绩效考核 第一节 传统金融机构的业绩评价方法 第二节 银行风险调整绩效指标RAROC 第三节 EVA绩效考核 第四节 以经济资本管理驱动价值创造第十章 资产证券化和次贷危机 第一节 资产证券化的原理概述 第二节 资产证券化产品简介 第三节 美国的次贷产品和次贷危机参考文献

· · · · · · [\(收起\)](#)

[金融风险度量与管理_下载链接1](#)

标签

金融风险管理

2018

评论

翻了翻，还挺全，该有的风险管理部分都有了，要我写书也会是按这么个顺序吧，不过文字部分过多，该用公式就该用公式表示

[金融风险度量与管理_下载链接1](#)

书评

[金融风险度量与管理_下载链接1](#)