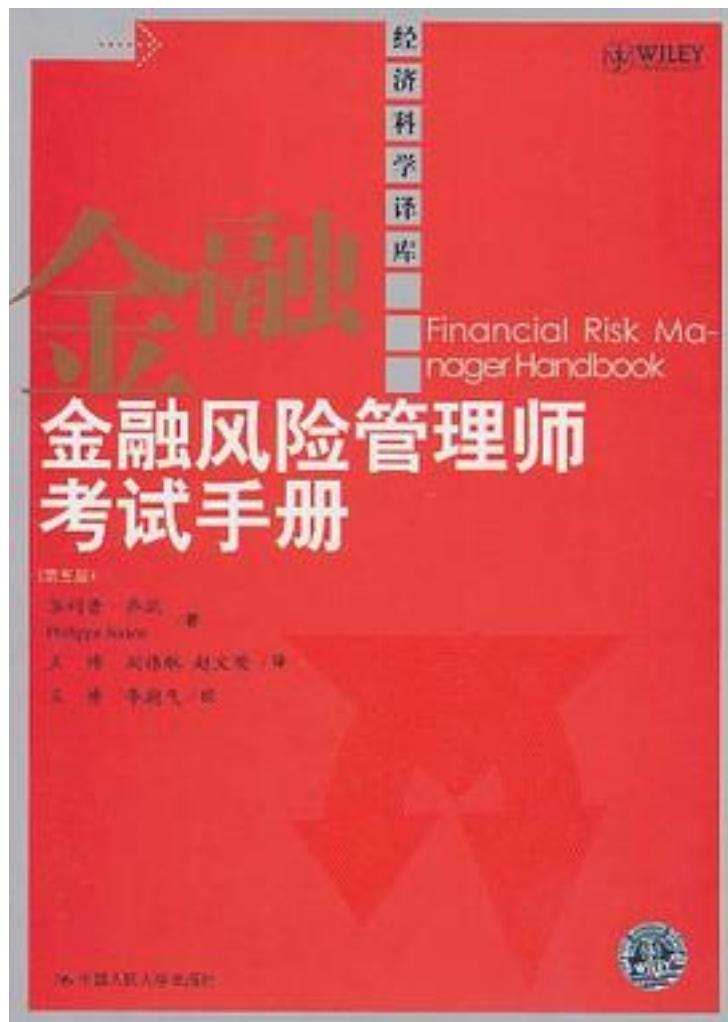


# 金融风险管理师考试手册



[金融风险管理师考试手册\\_下载链接1](#)

著者:菲利普·乔瑞

出版者:中国人民大学

出版时间:2011-2

装帧:

isbn:9787300131726

《金融风险管理师考试手册(第5版)》具有深远和务实的见解,是世界范围内风险管理培

训项目的核心手册。它帮助考生准备全球风险专业协会 (GARe) 的FRM考试,这是衡量金融风险管理标准的全球性考试,同时还能帮助考生在当今急速变化的金融世界中评估和控制风险。《金融风险管理师考试手册(第5版)》由风险管理专家菲利普.乔瑞撰写,并且得到了GARP的全力支持。《金融风险管理师考试手册(第5版)》把金融风险管理者们的核心知识架构概括如下:

市场,信用,操作,流动性和整体风险管理

数量分析方法

资本市场

投资管理和对冲基金风险

与风险管理相关的监管和法律问题

FRM被认为是世界上最具声望的衡量金融风险管理能力的全球性认证。由于FRM考试是世界范围内风险管理者的根本要求,《金融风险管理师考试手册(第5版)》致力于金融风险管理的实务技术以及解决问题的方法,这在实际中相当重要。通过以前考试题目的解析,考生可以准备FRM考试并且迎接在职业生涯中肯定将面对的风险管理挑战。

致力于获得金融风险管理师(FRM)认证的风险管理专业人员都用《金融风险管理师考试手册(第5版)》来学习和更新关于金融风险管理的综合信息。

点击链接进入英文版:

[Financial Risk Manager Handbook \[With CDROM\]](#)

作者介绍:

菲利普 · 乔瑞, 芝加哥大学MBA、博士, 比利时布鲁塞尔大学工学学士。现为州大学欧文分校金融学教授, 曾执教哥伦比亚大学和西北大学。主要研究领域为风险管理、国际金融、全球资产配置和固定收益证券市场。乔瑞博士已经发表了70多篇文章, 主题涉及风险管理与国际金融领域的学术和实务。他是《风险杂志》的主编, 也是一些金融杂志的编委会成员。他曾获得史密斯 · 布里登研究奖和威廉 · 夏普金融研究学术奖。

目录: 第1部分 数量分析 第1章 债券的基本原理 1. 1 折现、现值和终值 1. 2  
价格-收益率关系 1. 3 债券价格的导数 1. 4 重要公式 1. 5 例题解答 第2章 概率论基础  
第3章 统计学基础 第4章 蒙特卡洛方法 第2部分 资本市场 第5章 衍生产品介绍 第6章  
期权 第7章 固定收益证券 第8章 固定收益衍生品 第9章 股票, 外汇和商品市场 第3部分  
市场风险管理 第10章 市场风险简介 第11章 风险的来源 第12章 对冲线性风险 第13章  
非线性风险: 期权 第14章 风险因子建模 第15章 VAR方法 第4部分 投资风险管理 第16章  
投资组合管理 第17章 对冲基金风险管理 第5部分 信用风险管理 第18章 信用风险导论  
第19章 度量统计违约风险 第20章 用市场价格度量违约风险 第21章 信用风险暴露  
第22章 信用衍生品和结构化产品 第23章 信用风险管理 第6部分  
法律、操作和全面风险管理 第24章 操作风险 第25章 流动性风险 第26章 全面风险管理  
第27章 法律问题 第7部分 监管与法规 第28章 对金融机构的监管 第29章 《巴塞尔协议》  
第30章 巴塞尔市场风险资本要求  
· · · · · (收起)

[金融风险管理师考试手册 下载链接1](#)

## 标签

风险管理

金融实务

## 评论

---

[金融风险管理师考试手册 下载链接1](#)

## 书评

好多不通顺的地方，也不知译者是用多久完成这项工作的。例：The slope coefficient,  $\beta(i)$  measures the exposure of  $i$  to the market factor and is also known as systematic risk. 译为“斜率系数 $\beta(i)$ 是股票*i*对市场风险因子的暴露，即系统风险。”  
“股票*i*对市场风险因...

---

还不如john&hull的那本书清晰，是个大杂烩，什么都编进来了。。。却什么都没讲透。。。越看越烦。。。

---

看了一些精华部分，叹为观止。如果有一天，我读完了这本书，我一定会在心里对自己说：我真的太牛了！！外国人写的金融类经典教材真的太有逻辑性了，看书一定要看原版就是这个道理。对比起来，国内的翻译版显得生硬晦涩，甚至有错误。公式推导、逻辑推演，堪称经典，思维逻辑真...

最新版的Financial Risk Manager Handbook，FRM考试必备，是金融风险管理领域的经典著作了，之前看过该书的第五版，写得很好，很经典，包含了风险管理领域的各个方面。强烈推荐！！

---

[金融风险管理师考试手册\\_下载链接1](#)