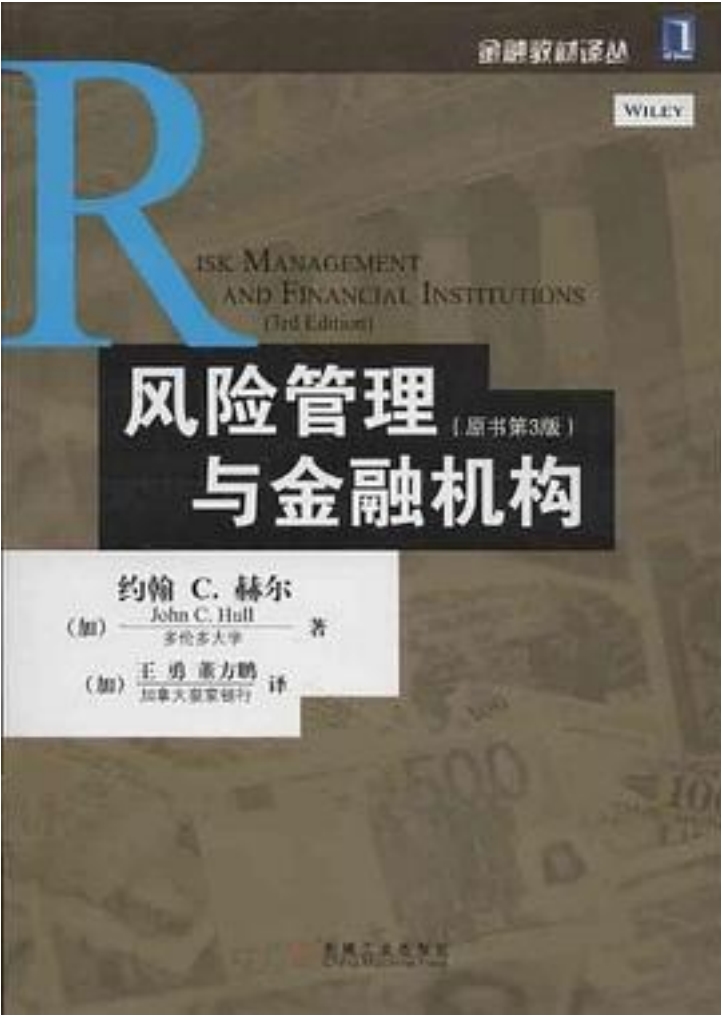


风险管理与金融机构



[风险管理与金融机构_下载链接1](#)

著者:John C. Hull

出版者:机械工业出版社

出版时间:2011-9

装帧:

isbn:9787111358633

《风险管理与金融机构(英文版·原书第2版)》侧重讲述银行和其他金融机构所面临的

风险，首先从风险与回报的替代关系入手，逐步深入地讨论了市场风险、信用风险和操作风险等，在讨论基础风险类型的同时也花了大量篇幅讨论《新巴塞尔协议》，并列举了近年来发生在金融界的重大损失案例，章后练习题和作业题帮助学生进一步理解概念，掌握操作程序及流程。

《风险管理与金融机构(英文版·原书第2版)》可作为高等院校金融及其相关专业的教材，也可作为金融交易和风险管理相关从业人员的参考用书。

《风险管理与金融机构(英文版·原书第2版)》英汉双语版由机械工业出版社和Pearson Education(培生教育出版集团)合作出版。未经出版者预先书面许可，不得以任何方式复制或抄袭《风险管理与金融机构(英文版·原书第2版)》的任何部分。此版本仅限在中华人民共和国境内(不包括中国香港、澳门特别行政区及中国台湾地区)销售。

《风险管理与金融机构(英文版·原书第2版)》封底贴有Pearson Education(培生教育出版集团)激光防伪标签，无标签者不得销售。

作者介绍:

目录: 出版说明

导读

前言

术语表

第1章 引言

1.1 投资人的风险回报关系

1.2 有效边界

1.3 资本资产定价模型

1.4 套利定价理论

1.5 公司的风险及回报

1.6 金融机构的风险管理

1.7 小结

推荐阅读

练习题

作业题

第2章 银行

2.1 商业银行

2.2 小型商业银行的资本金要求

2.3 存款保险

2.4 投资银行业

2.5 证券交易

2.6 银行内部潜在的利益冲突

2.7 今天的大型银行

2.8 银行所面临的风险

2.9 小结

推荐阅读

练习题

作业题

第3章 保险公司和养老基金

3.1 人寿保险

3.2 年金

3.3 死亡率表

3.4 长寿风险和死亡风险

3.5 财产及伤害险

3.6 健康保险
3.7 道德风险以及逆向选择
3.8 再保险
3.9 资本金要求
3.10 保险公司面临的风险
3.11 监管条款
3.12 养老金计划
3.13 小结

推荐阅读

练习题

作业题

第4章 共同基金和对冲基金

4.1 共同基金
4.2 对冲基金
4.3 对冲基金的策略
4.4 对冲基金的收益
4.5 小结

推荐阅读

练习题

作业题

第5章 金融产品

5.1 市场
5.2 资产的长头寸和短头寸
5.3 衍生产品市场
5.4 最基本的衍生产品
5.5 保证金
5.6 非传统衍生产品
5.7 奇异期权和结构性产品
5.8 风险管理的挑战
5.9 小结

推荐阅读

练习题

作业题

第6章 交易员如何管理风险暴露

6.1 Delta
6.2 Gamma
6.3 Vega
6.4 Theta
6.5 Rho
6.6 希腊值的计算
6.7 泰勒级数展开
6.8 对冲的现实状况
6.9 奇异型产品对冲
6.10 情景分析
6.11 小结

推荐阅读

练习题

作业题

第7章 利率风险

7.1 净利息收入管理
7.2 伦敦银行同业拆借利率和互换利率
7.3 利率久期
7.4 曲率
7.5 推广

7.6 收益曲线的非平行移动

7.7 利率敏感性

7.8 主成分分析法

7.9 Gamma和Vega

7.10 小结

推荐阅读

练习题

作业题

第8章 风险价值度

8.1 VaR的定义

8.2 VaR计算例子

8.3 VaR与预期亏损

8.4 VaR和资本金

8.5 满足-致性条件的风险度量

8.6 VaR中的参数选择

8.7 边际VaR、递增VaR及成分VaR

8.8 回顾测试

8.9 小结

推荐阅读

练习题

作业题

第9章 波动率

9.1 波动率的定义

9.2 隐含波动率

9.3 采用历史数据来估算波动率

9.4 金融变量的每日变化量是否服从正态分布

9.5 监测日波动率

9.6 指数加权移动平均模型

9.7 GARCH (1, 1) 模型

9.8 模型选择

9.9 最大似然估计法

9.10 采用GARCH (1, 1) 模型来预测波动率

9.11 小结

推荐阅读

练习题

作业题

第10章 相关系数与Copula函数

10.1 相关系数的定义

10.2 监测相关系数

10.3 多元正态分布

10.4 Copula函数

10.5 将Copula函数应用于贷款组合

10.6 小结

推荐阅读

练习题：

作业题

第11章 银行管理条约、《新巴塞尔协议》和偿付217能力法案II

11.1 对银行资本进行监管的原因

11.2 1988年之前

11.3 1988年《巴塞尔协议》

11.4 G30政策推荐

11.5 净额结算

11.6 1996年修正案

11.7 《新巴塞尔协议》

- 11.8 《新巴塞尔协议》中的信用风险资本金
- 11.9 《新巴塞尔协议》对操作风险的处理
- 11.10 第2支柱：监督审查过程
- 11.11 第3支柱：市场纪律
- 11.12 对《新巴塞尔协议》的改进
- 11.13 偿付能力法案11
- 11.14 小结

推荐阅读

练习题

作业题

第12章 市场风险：历史模拟法

12.1 方法论

12.2 VaR的精确度

12.3 历史模拟法的推广

12.4 极值理论

12.5 极值理论的应用

12.6 小结

推荐阅读

练习题

作业题

第13章 市场风险：模型构建法

13.1 基本方法论

13.2 推广

13.3 相关性矩阵和协方差矩阵

13.4 对于利率变量的处理

13.5 线性模型的应用

13.6 线性模型与期权产品

13.7 二次模型

13.8 蒙特卡罗模拟

13.9 对非正态分布的假设

13.10 模型构建法与历史模拟法的比较

13.11 小结

推荐阅读

练习题

作业题

第14章 信用风险：估测违约概率

14.1 信用评级

14.2 历史违约概率

14.3 回收率

14.4 信用违约互换

14.5 信用溢差

.....

第15章 信用风险损失和信用风险价值度

第16章 资产抵押证券、债务抵押债券及2007年信用紧缩

第17章 情景分析和压力测试

第18章 操作风险

第19章 流动性风险

第20章 模型风险

第21章 经济资本金与RAROC

第22章 重大金融损失和借鉴意义

附录A 利率复利频率

附录B 零息利率、远期利率及零息收益率

附录C 远期合约和期货合约的定价

附录D 互换合约定价

- 附录E 欧式期权定价
- 附录F 美式期权定价
- 附录G 泰勒级数展开
- 附录H 特征向量和特征值
- 附录I 主成分分析法
- 附录J 对信用转移矩阵的处理
- 练习题答案
- • • • • ([收起](#))

[风险管理与金融机构_下载链接1](#)

标签

- 金融
- 风险控制
- 风险
- 经济学
- 英文原版
- 案例
- FRM

评论

感觉基本就是约翰赫尔的期权期货和其他金融衍生品的精简版。

[风险管理与金融机构_下载链接1](#)

书评

本书是关于金融机构风险管理的经典教材，是赫赫有名的john hull所著。以前读研究生时读过他的论文。本书先从风险的基本知识出发，解释一般意义上的风险和回报之间的关系，对风险如何衡量和定价，推出有风险的资产如何定价的两个经典模型。然后，本书对银行、投行、保险公司、基...

这本教材甚称经典，虽然全英文的内容开始看着有点吃力，慢慢就能够加快速度了。对于企业风险方面的分析都非常到位，案例也不错。在同类书籍中算是非常棒的。至少写书的人不忽悠。

如果英文水平不好的朋友可以选择中文版的来看，会好理解多了。Let 's be a CRO.

[风险管理与金融机构_下载链接1](#)