

<<金融风险管理的理论与实践>>

图书基本信息

书名：<<金融风险管理的理论与实践>>

13位ISBN编号：9787030161734

10位ISBN编号：7030161734

出版时间：2006-11

出版时间：科学出版社发行部

作者：田新时

页数：392

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>

## <<金融风险管理的理论与实践>>

### 内容概要

本书详尽地描述了基于VaR的金融风险管理。

全书共有23章，由5部分组成，分别为机缘、基石、系统、应用和结论。

“机缘”解释了为什么选择这样一个时机和为什么需要引入基于VaR的金融风险，“基石”介绍了VaR风险管理的基础理论与基本方法，“系统”介绍了这一风险管理方法的体系，而“应用”列举了当前使用这一系统的状况和问题，最后，给出了“结论”。

本书汇总了作者多年来从事“金融风险管理”课程教学的内容和当前的一些研究工作成果。

每一章均给出了思考与练习题，并提供了两个综合性大作业。

本书配备多媒体教学课件和教学科研支持网站，可作为普通院校经济管理专业和财经类院校本科生、研究生“金融风险管理”课程的教材，也可以作为业内培训教材或参考书。

<<金融风险管理的理论与实践>>

书籍目录

序前言第一部分 机缘 第1章 导论 第2章 从金融灾难事件中得到的教训 第3章 巴塞尔委员会的监管条例 第4章 公允价值会计与VaR风险管理机制第二部分 基石 第5章 金融市场回报的统计量 第6章 “险阵”的波动率与相关性预测 第7章 现金流映像 第8章 线性头寸的风险度量 第9章 后测检验 第10章 非线性头寸的风险值度量第三部分 系统 第11章 结构化蒙特卡洛模拟 第12章 压力试验 第13章 信用风险 第14章 流动性风险 第15章 市场变量分布的非正态性和分位点方法第四部分 应用 第16章 利用VaR控制和度量风险 第17章 利用VaR进行主动式的风险管理 第18章 操作风险管理 第19章 集成式风险管理 第20章 VaR在投资管理中的应用 第21章 险阵数据组的相关统计问题

<<金融风险管理的理论与实践>>

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>