

<<钢材期货风险管理>>

图书基本信息

书名：<<钢材期货风险管理>>

13位ISBN编号：9787216073332

10位ISBN编号：7216073339

出版时间：2012-12

出版时间：刘勇 湖北人民出版社 (2012-12出版)

作者：刘勇

页数：246

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>

## <<钢材期货风险管理>>

### 内容概要

《钢材期货风险管理》主要包括：钢材基础知识与市场概况；期货基础知识；钢材期货市场与钢材期货交易流程；钢材期货市场风险类型、特点、管理原则与方法等。

## &lt;&lt;钢材期货风险管理&gt;&gt;

## 书籍目录

第一章 钢材基础知识与市场概况 第一节 钢材基础知识 一、钢材的性能和分类 二、钢铁生产工艺 三、螺纹钢的生产工艺和用途 四、线材的生产工艺和用途 第二节 我国钢材市场概况 一、我国钢材市场的基本状况 二、我国螺纹钢市场 三、我国线材市场 四、钢材价格变化状况与影响因素 第二章 期货基础知识 第一节 期货市场概述 一、期货市场的含义 二、期货市场的产生 三、期货市场的发展 四、期货市场的功能和作用 五、中国期货市场的产生与发展 第二节 期货市场组织结构 一、期货交易所 二、期货结算机构 三、期货经纪公司 四、期货监管机构和期货行业自律机构 五、期货投资者 第三节 期货交易和期货合约 一、期货交易 二、期货合约 第三章 钢材期货市场与钢材期货交易流程 第一节 世界钢材期货市场概况 一、印度钢材期货简介 二、日本废钢期货简介 三、迪拜黄金与商品交易所螺纹钢期货简介 四、伦敦金属交易所钢坯期货简介 五、美国钢材期货简介 第二节 我国钢材期货市场发展历程 一、最初推出钢材期货市场的原因 二、钢材期货市场经历的过程 三、我国重新推出钢材期货市场的必要性 四、钢材期货市场在钢铁企业生产经营中的作用 第三节 钢材期货合约和行情 一、上海期货交易所钢材期货合约介绍 二、钢材期货行情 第四节 钢材期货交易流程 一、钢材期货开户程序 二、钢材期货交易流程 第四章 钢材期货市场风险类型、特点、管理原则与方法 第一节 风险管理的基本理论 一、风险管理理论的演变 二、风险的含义 三、期货市场风险的含义 四、钢材期货市场风险的含义 第二节 钢材期货市场风险类型与特点 一、钢材期货市场风险的类型 二、钢材期货市场风险的主要特点 第三节 钢材期货市场风险管理的必要性 一、钢材期货市场风险管理的含义 二、钢材期货市场风险控制的核心是有效的风险管理 三、有效的风险管理是钢材期货市场充分发挥功能的前提和基础 四、有效的风险管理是减缓和消除钢材期货市场对钢材市场不良冲击的需要 五、有效的风险管理是适应世界经济自由化和国际化发展的需要 第四节 钢材期货市场风险管理的原则 一、全面细致的原则 二、事先预防的原则 三、量力而行的原则 四、量化的原则 五、制度化、经常化的原则 第五节 钢材期货市场风险管理的方法 一、风险价值模型 二、情景分析法 三、压力测试法 第五章 钢材期货市场客户的内部风险管理 第一节 钢材期货市场客户的风险来源 一、代理风险 二、价格风险 三、客户自身因素导致的风险 第二节 客户的风险管理 一、了解钢材期货交易的特点,掌握钢材期货行情分析方法 二、慎重选择期货经纪公司 三、制定正确投资战略,将风险降至可以承受的程度 四、规范自身行为,提高风险意识 五、投资的资金规模必须正当、适度 六、关注信息、分析形势 七、机构客户(企业)的内部风险管理 第六章 钢材期货市场客户的外部风险管理 第一节 期货交易所的风险源 一、监控执行力度 二、异常价格波动风险 第二节 期货交易所的风险管理 一、正确建立和严格执行有关风险监控制度 二、建立钢材期货交易全过程风险实时监控体系 三、建立和严格管理风险基金 第三节 期货经纪公司的风险类型 一、期货经纪公司面临的外部风险 二、期货经纪公司面临的内部风险 第四节 期货经纪公司的风险管理 一、进一步完善期货经纪公司治理结构 二、设立向董事会负责的风险管理委员会 三、建立期货经纪公司全面风险管理系统 四、建立稳定高效的硬件环境 五、加强人力资源管理,积极开展员工培训,提高员工的业务能力 第五节 钢材期货市场宏观风险管理 一、立法管理 二、行政管理 三、行业自律管理 第七章 钢材期货风险量化及控制 第一节 早期的风险量化理论 一、马柯维茨的均值——方差理论 二、Downside—risk方法与哈洛资产配置理论 三、资本资产定价模型(CAPM)和套利定价理论(APT) 四、期权定价理论 第二节 现代的钢材期货风险量化理论 一、风险的敏感性分析法 二、VaR方法 三、整体风险管理理论TRM 第三节 钢材期货风险管理的发展趋势——全面风险管理ERM 附录 期货术语(中英文对照)参考文献

## <<钢材期货风险管理>>

### 编辑推荐

纵观世界期货市场一百多年的发展历程，风险管理和风险控制一直是客户、期货经纪公司、交易所和政府监管部门都不可回避的问题。

风险管理理论从20世纪30年代开始萌芽，此后，对风险管理的研究逐步趋向系统化、专门化，风险管理在西方发达国家得到了迅猛的发展。

我国内地的风险管理理论研究起步较晚，从20世纪80年代才开始从美国等西方国家引入风险理论，并逐渐发展。

我国的钢材期货市场成立时间较短，有关钢材期货风险管理研究文献更是少之甚少。

正是在这样的大背景下，刘勇专著的《钢材期货风险管理》从客户角度对钢材期货风险管理进行了系统研究。

<<钢材期货风险管理>>

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>