

<<金融风险管理师考试手册>>

图书基本信息

书名：<<金融风险管理师考试手册>>

13位ISBN编号：9787300148373

10位ISBN编号：7300148379

出版时间：2012-2

出版时间：中国人民大学出版社

作者：菲利普·乔瑞

页数：687

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>

## <<金融风险管理师考试手册>>

### 内容概要

本书是致力于获得金融风险管理师(FRM)认证的风险管理专业人员的重要参考书。

本书第六版对内容进行了全面更新,反映了金融市场的最新发展和FRM项目结构的最新变化。

本书的结构现在对应于FRM的两级考试。

所有的章节都对最近的金融市场和监管进行了更新。

本版包含了FRM考试的最新试题。

本书第六版有助于考生准备全球风险专业协会(GARP)的FRM考试,它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>>

作者简介

王博，江苏徐州人，1986年出生，中国人民大学应用经济学博士研究生，中国准精算师(ACAA)，国际金融风险管理师(FRM)，具有金融风险管理领域的丰富研究成果和实践经验，并在相关学术会议和核心期刊上发表多篇论文。

<<金融风险管理师考试手册>>

书籍目录

第1部分 风险管理基础

第1章 风险管理

- 1.1 风险度量
- 1.2 风险管理过程的评估
- 1.3 构建投资组合
- 1.4 资产定价理论
- 1.5 风险管理的评估
- 1.6 重要公式
- 1.7 例题解答

第2部分 数量分析

第2章 概率论基础

- 2.1 刻画随机变量
- 2.2 多元分布函数
- 2.3 随机变量函数
- 2.4 重要的分布函数
- 2.5 均值分布
- 2.6 重要公式
- 2.7 例题解答

附录A 矩阵乘法回顾

附录8 正态分布

第3章 统计学基础

- 3.1 参数估计
- 3.2 回归分析
- 3.3 重要公式
- 3.4 例题解答

第4章 蒙特卡洛方法

- 4.1 随机变量的模拟
- 4.2 模拟实现
- 4.3 风险的多种来源
- 4.4 重要公式
- 4.5 例题解答

第5章 风险因子建模

- 5.1 现实数据
- 5.2 正态分布和对数正态分布
- 5.3 肥尾
- 5.4 风险的时间序列
- 5.5 重要公式
- 5.6 例题解答

第3部分 金融市场和产品

第6章 债券的基本原理

- 6.1 折现、现值和终值
- 6.2 价格—收益率关系
- 6.3 债券价格的导数
- 6.4 久期和凸度
- 6.5 重要公式

<<金融风险管理师考试手册>>

- 6.6 例题解答
- 附录 无穷级数的应用
- 第7章 衍生产品介绍
  - 7.1 衍生产品市场综述
  - 7.2 远期合约
  - 7.3 期货合约
  - 7.4 互换合约
  - 7.5 重要公式
  - 7.6 例题解答
- 第8章 期权
  - 8.1 期权收益
- 第9章 固定收益证券
- 第10章 固定收益衍生品
- 第11章 股票、外汇和商品市场
- 第4部分 估值与风险模型
  - 第12章 风险模型简介
  - 第13章 管理线性风险
  - 第14章 非线性（期权）风险模型
- 第5部分 市场风险管理
  - 第15章 风险模型：一元情形
  - 第16章 高级风险模型：多元情形
  - 第17章 管理波动率风险
  - 第18章 抵押证券风险
- 第6部分 信用风险管理
  - 第19章 信用风险导论
  - 第20章 度量统计违约风险
  - 第21章 用市场价格度量违约风险
  - 第22章 信用风险暴露
  - 第23章 信用衍生品和结构化产品
  - 第24章 信用风险管理
- 第7部分 操作风险和全面风险管理
  - 第25章 操作风险
  - 第26章 流动性风险
  - 第27章 全面风险管理
  - 第28章 《巴塞尔协议》
- 第8部分 投资风险风险管理
  - 第29章 机资组合管理
  - 第30章 对冲基金风险管理

<<金融风险管理师考试手册>>

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>