第一图书网, tushu007.com

# <<金融风险管理>>

## 图书基本信息

书名：<<金融风险管理>>

13位ISBN编号：9787302296362

10位ISBN编号：7302296367

出版时间：2012-8

出版时间：清华大学出版社

作者：高晓燕 编

页数：262

字数：393000

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

## 内容概要

高晓燕等编著的《金融风险管理》通过运用最新的风险分析工具，对信用风险、流动性风险、市场风险、利率风险、汇率风险、证券投资组合风险、操作风险、法律风险及其他风险的风险管理等进行了系统分析，并提出相应的定价模型和风险管理模型。
对金融风险管理的发展环境及未来发展趋势进行了研究。
论述了金融风险管理的基本结构、程序、技能要求和管理模型；梳理了基本的、国际上通用的金融风险识别、衡量技术。
对金融风险管理进行了全面系统的分析研究。

《金融风险管理》力求突出几个特色：系统性，新颖性，现实性。
本书适合经济管理类专业本科生、专科生使用，适合做银行从业资格考试的学员培训教材。

# <<金融风险管理>>

## 书籍目录

第一章 金融风险管理概述
第一节 金融风险概论
一、金融风险的概念
二、金融风险的分类
三、金融风险的特点
四、金融风险的产生原因
五、我国金融风险产生的特殊原因
第二节 金融风险管理的内涵、意义及其发展
一、金融风险管理的内涵
二、金融风险管理的意义
三、金融风险管理的发展
第三节 金融风险的监督管理
一、金融风险监管的理论根源及其有效性的争论
二、金融风险监管的目标和原则
三、金融风险监管体制
案例分析广东省国际信托投资公司的破产
思考题
第二章 金融风险管理的框架
第一节 金融风险管理系统
一、金融风险管理的衡量系统
二、金融风险管理的决策系统
三、金融风险管理的预警系统
四、金融风险管理的监控系统
五、金融风险管理的补救措施
六、金融风险管理的评估系统
七、金融风险管理的辅助系统
第二节 金融风险管理的组织结构
一、金融机构风险管理组织结构设计的基本原则
二、金融机构风险管理的组织体系
三、风险管理的组织结构模式
四、实例分析：我国国有控股商业银行风险管理组织结构
第三节 金融风险管理的一般程序
一、金融风险的识别与分析
二、风险评估
三、风险管理对策的选择和实施方案的设计
四、金融风险管理方案的实施
五、风险报告
六、风险管理的评估
七、风险确认和审计
案例分析行长挪用巨额公款炒股本金无归
思考题
第三章 利率风险的管理
第一节 利率风险概述
一、利率风险的分类
二、影响利率风险的因素

三、利率风险的成因分析
第二节 利率风险的衡量
一、利率期限结构
二、持续期
三、凸性
第三节 利率风险的管理
一、利率风险管理的含义
二、利率风险管理的必要性
三、利率风险管理的重点
四、利率风险管理的方法
第四节 我国的利率风险管理
一、我国利率风险控制与管理的有关问题
二、我国商业银行利率风险控制方略
三、我国商业银行利率风险衡量方法
案例分析发生在美国奎克国民银行的故事
思考题
第四章 汇率风险的管理
第一节 汇率风险概述
一、汇率风险的概念
二、汇率风险的成因分析
三、汇率风险的影响
第二节 汇率风险的类型
第三节 汇率风险衡量
一、净外汇风险敞口
二、汇率风险衡量
第四节 汇率风险的管理
一、汇率风险管理原则
二、汇率风险的管理战略
三、汇率风险的控制
四、我国汇率风险管理的现状、存在问题、发展方向
案例分析汇率风险案例
思考题
第五章 金融衍生工具及其风险管理
第一节 金融衍生工具概述
一、金融衍生工具的概念和特征
二、金融衍生工具的分类
三、金融衍生工具的主要功能
四、金融衍生工具的产生与发展动因
第二节 金融衍生工具的定价与风险度量
一、金融衍生工具的定价
二、风险度量
第三节 衍生金融工具的风险管理
一、金融衍生工具的风险类型
二、风险管理的目标
三、金融衍生工具风险的管理
四、我国金融衍生产品的风险管理
案例分析金融衍生产品交易案例

思考题
第六章 证券投资组合风险管理
第一节 资产组合理论
一、证券收益率和风险的测定
二、影响证券组合风险的因素
三、证券投资风险的概述
四、现代资产组合理论
五、无风险借贷对有效集的影响
六、现代证券投资组合理论的局限性
七、资产组合管理理论对中国的现实意义
第二节 资本资产定价理论
一、资本资产定价模型的假设
二、分离定理
三、市场组合
四、资本市场线(cML)
五、证券市场线(sML)
六、资本市场线和证券市场线的关系
七、口系数
八、资本资产定价模型的扩展
九、资本资产定价模型的意义
第三节 指数模型与套利定价理论
一、指数模型
二、套利定价理论
三、我国的证券投资组合风险管理的现状及存在的问题
四、针对我国证券市场的现状提出的措施
案例分析长期资本管理公司的兴衰及启示
思考题
第七章 流动性风险的管理
第一节 流动性风险概述
一、流动性风险的内涵
二、流动性风险的特征
三、流动性风险的作用
第二节 流动性风险管理理论
一、资产管理理论
二、负债管理理论
三、资产负债综合管理理论
第三节 流动性风险的衡量
一、流动性比率或指标
二、现金流分析
三、其他衡量方法
第四节 流动性风险的管理技术
一、流动性风险的识别
二、流动性风险的预警
三、压力测试
四、情景分析
案例分析海南发展银行的关闭
思考题

第八章 信用风险管理
第一节 信用风险概述
一、信用风险的概念
二、信用风险的来源
三、信用风险的类型
四、信用风险的影响因素
五、信用风险的特征
六、我国信用风险的特点
第二节 信用风险度量方法
一、传统的信用风险度量方法
二、现代信用风险度量模型
第三节 信用风险管理方法
一、信用风险管理方法的演变
二、信用风险管理方法
三、现代信用风险的管理手段
四、现代信用风险管理的发展趋势
第四节 我国信用风险管理现状
一、我国国有商业银行的风险特征
二、我国商业银行信用风险内部评级的现状和问题
三、完善我国商业银行信用风险内部评级体系的建议
案例分析从次贷危机到全球金融危机
思考题
第九章 操作风险管理
第一节 操作风险概述
一、操作风险的定义
二、操作风险的特点
第二节 操作风险的管理
一、加强防范操作风险的对策
二、操作风险管理的任务和原则
三、我国商业银行操作风险的管理实践
第三节 商业银行操作风险的案例分析
一、国际操作风险案例介绍
二、国内操作风险案例介绍
三、案例分析的启示：如何防范操作风险
案例分析法国兴业银行巨亏
思考题
第十章 其他风险管理
第一节 法律风险管理的概述
一、法律风险及其管理的定义
二、构建法律风险防范机制的现实意义
三、法律风险的具体防控措施
第二节 声誉风险管理
一、声誉风险的定义及形式
二、加强声誉风险管理的意义
三、声誉风险管理存在的困难
四、声誉风险管理的有效措施
案例分析“吴英神话”：法律背后的乱象

思考题
第十一章 金融风险管理的未来
第一节 金融风险管理发展趋势
一、培育风险管理文化
二、重构风险管理体制
三、提升风险管理技术
第二节 《巴塞尔新资本协议》
一、巴塞尔协议的发展历程
二、巴塞尔新协议的主要内容
三、巴塞尔资本协议与商业银行风险管理
四、巴塞尔协议在中国
案例分析《巴塞尔协议III》的进展及其影响
思考题
附录A
附录B 中国银监会关于印发《商业银行操作风险管理指引》的通知
参考文献

## 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