

<<金融工程实验教程>>

图书基本信息

书名：<<金融工程实验教程>>

13位ISBN编号：9787307062740

10位ISBN编号：7307062747

出版时间：2008-7

出版时间：武汉大学出版社

作者：胡利琴 编

页数：196

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>

## 前言

风险管理是各经济主体参与金融活动时的重要内容。

随着布雷顿森林体系的崩溃和金融管制的逐步放松，特别是20世纪80年代后金融危机频繁发生，国际银行业重新认识到资本对风险防范的重要意义，巴塞尔委员会于1988年颁布了“巴塞尔协议”，强调资本缓冲风险的本质，在风险与资本之间建立明确的关系，银行开始步入以资本管理作为核心的新型风险管理阶段。

20世纪90年代以后，随着银行经营环境的变化，银行股东不再一味追求红利收益，而是更看重资本增值，评级机构也从纯粹的债项评级转向对银行全面财务状况的评级，这些促使银行开始考虑资本的成本与收益，即将资本管理纳入决策过程当中，但是资本的计量仍然以监管资本为主。

近些年随着银行经营环境的变化、信息技术和风险量化技术的提高，巴塞尔委员会提出了更灵活、更具有风险敏感性的新资本监管框架，鼓励银行自主开发内部模型，资本管理也开始全面渗透到银行经营管理的各个环节，由半主动的管理方式转向积极主动的全面风险管理模式。

因此，寻求全面、有效的风险度量内部模型对于提高银行的风险管理能力至关重要。

本书以巴塞尔协议的指导思想为线索，全面介绍了市场风险、信用风险和操作风险的度量思想和过程；各类风险的度量依照基本思想——步骤——案例的思路进行展开，较好地展示了风险度量的实验过程，便于学生理解和掌握；书中案例的实现采用了Eviews, VBA, Splus, Matlab等多种软件，便于学生选择性地学习和运用；结合众多方法和案例，突出了操作风险的介绍，这有助于提高学生分析复杂风险的能力。

本书可作为大学金融本科专业《金融实验》课程的教材，也可作为风险管理者的操作参考手册。

## <<金融工程实验教程>>

### 内容概要

《金融工程实验教程：金融工程之风险管理》以巴塞尔协议的指导思想为线索，全面介绍了市场风险、信用风险和操作风险的度量思想和过程；各类风险的度量依照基本思想——步骤——案例的思路进行展开，较好地展示了风险度量的实验过程，便于学生理解和掌握；书中案例的实现采用了Eviews, VBA, Splus, Matlab等多种软件，便于学生选择性地学习和运用；结合众多方法和案例，突出了操作风险的介绍，这有助于提高学生分析复杂风险的能力。

书籍目录

第一章 金融风险的传统度量方法第一节 传统风险度量方法概述第二节 波动性风险度量法第三节 灵敏度测量方法第二章 金融风险的现代度量方法第一节 现代风险度量方法概述第二节 Var风险度量法第三节 ES风险度量法第三章 交易账户市场风险度量第一节 债券市场风险度量第二节 外汇资产市场风险的度量第三节 股票资产市场风险的度量第四章 非交易账户市场风险度量第一节 非交易账户市场风险度量方法概述第二节 利率敏感性缺口法第三节 持续期缺口法第四节 期权调整差价模型第五章 信用风险的度量第一节 信用风险度量概述第二节 KMV模型第三节 Credit Metrics模型第四节 组合信用风险的度量第六章 操作风险度量初级法第一节 操作风险度量概述第二节 基本指标法第三节 标准法第四节 评级法第七章 操作风险度量高级法第一节 高级法概述第二节 损失分布法第三节 极值理论第四节 记分卡法第五节 贝叶斯网络参考文献

<<金融工程实验教程>>

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>