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：9787309082746

10位ISBN编号：7309082745

出版时间：2011-8

出版时间：复旦大学

作者：张金清

页数：323

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

由张金清编著的《金融风险管理(第二版)》首先详细讨论和界定了有关金融风险及其所包含的各类主要风险的定义、特性等一些基本概念和基本知识，在此基础上全面、系统、深入地介绍、阐释、分析了各类金融风险的辨识理论、方法以及市场风险、信用风险、操作风险和流动性风险这四类主要风险的各种度量理论、方法与技术。
另外，《金融风险管理(第二版)》还涉及到了上述四类金融风险度量理论和方法的历史演变以及经典的VaR方法，等等。
与第一版相比，本版的改动并不大，主要是对第一版中存在的失误和不足的修正、补充和完善。

《金融风险管理(第二版)》可作为经济、金融、管理类的教师、研究人员、高年级本科生和研究生以及实践领域的金融工作者的教材或参考书。

<<金融风险管理>>

书籍目录

第一章 金融风险的基本概念解析
第一节 金融风险的定义及特性分析
一、金融风险的概念
二、金融风险的特点
三、金融风险的来源分析
四、金融风险的经济结果分析
五、金融风险与未预期损失、经济资本、监管资本等概念之间的关系
第二节 金融风险的分类
第三节 金融市场风险
引例 基于三个典型案例对金融市场风险的认识
一、市场风险的定义与特性
二、市场风险的分类
第四节 信用风险
引例 基于百富勤倒闭事件对信用风险的认识
一、信用风险的概念
二、信用风险的分类
三、信用风险与市场风险的区别与联系
第五节 操作风险
引例 基于巴林银行事件对操作风险的认识
一、操作风险的概念
二、操作风险的基本特性
三、 操作风险的分类
第六节 流动性风险
引例 基于美国大陆伊利诺银行流动性危机对流动性风险的认识
一、流动性风险的概念
二、流动性风险的成因与特性分析
三、流动性风险的分类
第七节 其他类型的金融风险
一、经营风险
二、国家风险
三、关联风险
第二章 金融风险辨识
第一节 金融风险辨识的概念和原则
一、金融风险辨识的概念
二、金融风险辨识的原则
三、金融风险辨识的作用
第二节 金融风险辨识的基本内容
一、金融风险类型和受险部位的识别
二、金融风险诱因和严重程度的辨识
第三节 风险辨识的基本方法
一、现场调查法
二、问卷调查法
三、组织结构图示法
四、流程图法
五、专家调查法

六、主观风险测定法
七、客观风险测定法
八、幕景分析法
九、模糊集合分析法
十、故障树分析法
十一、其他方法简述
十二、金融风险辨识方法评述
第三章 金融市场风险的度量
第一节 金融市场风险度量方法的演变
一、名义值度量法
二、灵敏度方法
三、波动性方法
四、VaR方法
五、压力试验和极值理论
六、集成风险或综合风险度量
第二节 灵敏度方法
一、简单缺口模型
二、到期日缺口模型或利率敏感性缺口模型
三、久期、凸性与缺口模型
四、β系数和风险因子敏感系数
五、金融衍生品的灵敏度测量
六、灵敏度度量法评述
第三节 波动性方法
一、单种资产风险的度量
二、资产组合风险的度量
三、特征风险、系统性风险与风险分散化
四、波动性方法的优缺点评述
第四节 VaR方法
一、VaR方法的基本概念
二、VaR的计算
三、边际VaR、增量VaR和成分VaR
四、VaR方法的优缺点评述
第五节 基于历史模拟法的VaR计算
一、基于标准历史模拟法计算VaR的基本原理和实施步骤
引例 基于标准历史模拟法的VaR计算举例
二、计算VaR的标准历史模拟法的评述
三、计算VaR的标准历史模拟法的修正及扩展
第六节 基于Monte Carlo模拟法的VaR计算
一、Monte Carlo模拟法
二、基于Monte Carlo模拟法的计算VaR的基本步骤
三、基于Monte Carlo模拟法计算VaR的应用举例
四、基于Monte Carlo模拟法VaR计算的评述
五、Monte Carlo模拟法的改进与扩展介绍
第七节 基于Delta，Gamma灵敏度指标的VaR计算
一、基于Delta类方法的VaR计算
二、基于Delta Gamma类方法的VaR计算
三、基于Hull White正态变换方法的VaR计算

第八节 厚尾分布事件中的市场风险度量——压力试验和极值理论
一、压力试验
引例 系统化压力试验举例
二、极值理论
引例 利用POT模型计算VaR举例
第四章 信用风险的度量
第一节 信用风险度量方法概述
一、专家分析法
二、评级方法
三、基于财务比率指标的信用评分方法
四、现代信用风险度量模型
第二节 度量信用风险的基本参数解析与估计
一、违约率的估计
二、违约损失率与回收率的估计
三、信用损失
引例 信用损失的VaR法应用案例
四、信用价差
第三节 信用评级方法
一、外部机构的信用评级方法
二、内部信用评级方法
第四节 信用等级转移分析与信用等级转移概率的计算
一、信用等级转移概率
二、联合信用等级转移概率
三、条件信用等级转移概率
第五节 基于财务分析指标的评分模型：Z值评分模型与ZETA模型
一、Z值评分模型的基本原理与应用
引例 Z值评分模型举例
二、改进的Z值评分模型：ZETA模型
三、Z值评分模型与ZETA模型评述
第六节 基于信用等级转移的CreditMetrics模型和信用组合观点
一、CreditMetrics模型的基本思想和应用程序
二、信用资产组合的CreditMetrics模型
引例 基于多因素股票收益率模型的相关系数的计算应用举例
三、CreditMetrics模型的适用范围与优缺点评述
四、基于条件信用等级转移的宏观模拟模型：信用组合观点
第七节 基于市场价值的违约模型(DM)：KMV模型
一、基于Merton(1974)公司债务定价思想的KMV方法
二、预期违约率(EDF)与评级
三、KMV的信用资产组合管理方法
四、KMV模型适用范围与优缺点评述
第八节 基于财险精算方法的违约模型(DM)：CreditRisk+模型
一、基本原理和模型
引例CreditRisk+ 模型的应用举例
二、CreditRisk+模型适用范围与优缺点评述
第九节 基于寿险精算方法的违约模型(DM)：死亡率模型
一、基本原理和模型
二、对死亡率模型的评价

第十节 不同信用风险度量模型的比较
第五章 操作风险的度量
第一节 操作风险度量的历史演变——兼述巴塞尔委员会对操作风险的度量与监管
一、第一阶段：以定性为主的操作风险度量方法
二、第二阶段：定性与量化结合的操作风险度量方法——基于新巴塞尔协议的框架
第二节 基本指标法和标准法
一、基本指标法(BIA)
二、标准法(SA)
第三节 内部度量法
一、内部度量法的一般步骤
二、内部度量法在应用中的不足与修正
第四节 损失分布法
一、操作风险事件描述
二、基于损失分布法度量操作风险的一般步骤
三、损失分布法的改进
引例 操作风险损失分布与未预期损失的计算举例
四、基于Monte Carlo模拟法的损失分布的估计
第五节 记分卡法与其他度量法
一、运用记分卡法度量操作风险的基本步骤
二、操作风险的其他度量方法
第六节 操作风险度量方法的比较与分析
一、关于基本指标法和标准法的比较与分析
二、高级度量法
三、贝叶斯神经网络模型和因果关系模型
附录 巴塞尔委员会对操作风险管理与监管的十项原则
第六章 流动性风险的度量
第一节 流动性风险度量方法概述
一、筹资流动性风险度量方法简介——兼述筹资流动性风险管理的理论与策略
二、市场流动性风险度量方法概述
第二节 筹资流动性风险的度量方法
一、指标体系分析法
二、缺口分析法
三、期限结构分析法
四、现金流量分析法
五、基于VaR的流动性风险价值法
六、行为L_VaR的估计
第三节 市场流动性风险的度量方法
一、基于买卖价差的外生性La_VaR法
二、内生市场流动性风险度量方法——基于最优变现策略的内生性La_VaR法
三、外生和内生市场流动性风险度量方法比较
附录 经济学和金融学中的随机理论初步
一、概率空间和随机变量
二、条件概率和条件期望
三、随机过程与鞅
四、随机积分与几个常用定理
五、随机微分方程
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