

<<风险管理计算与建模>>

图书基本信息

书名：<<风险管理计算与建模>>

13位ISBN编号：9787313076892

10位ISBN编号：7313076894

出版时间：2011-9

出版时间：上海交大

作者：王周伟

页数：243

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>

## <<风险管理计算与建模>>

### 内容概要

风险管理涉及较多的计算与建模，往往比较复杂，手工计算工作量很大。根据原理，借助软件计算，是风险管理人才培养与工作实践中非常重要的内容。

由王周伟编著的《风险管理计算与建模》的目的在于帮助学生熟练掌握风险管理的原理，提高学生风险管理计算与建模的技能。

《风险管理计算与建模》可以作为经济管理类本科生或研究生的风险管理、金融工程等课程的计算与建模训练教学教材，也可以作为应用统计类专业硕士的专业教材。

## &lt;&lt;风险管理计算与建模&gt;&gt;

## 书籍目录

## 第1章 金融资产收益波动率的计算

## 1.1 静态波动率的计算

- 1.1.1 实验目的
- 1.1.2 基本原理
- 1.1.3 实验数据与内容
- 1.1.4 操作步骤与结果

## 1.2 动态波动率的计算

- 1.2.1 实验目的
- 1.2.2 基本原理
- 1.2.3 实验数据与内容
- 1.2.4 操作步骤与结果

## 1.3 隐含波动率的计算

- 1.3.1 实验目的
- 1.3.2 基本原理
- 1.3.3 实验数据与内容
- 1.3.4 操作步骤与结果

## 第2章 损失分布的拟合与模拟估计

## 2.1 损失分布拟合的Excel图形判断与K-S检验

- 2.1.1 实验目的
- 2.1.2 基本原理
- 2.1.3 实验数据及内容
- 2.1.4 操作步骤及结果

附件2.1 Excel中的描述统计函数

附件2.2 Excel中的概率分布计算函数

## 2.2 损失分布拟合的Excel卡方检验

- 2.2.1 实验目的
- 2.2.2 基本原理
- 2.2.3 实验数据与内容
- 2.2.4 操作步骤及结果

## 2.3 损失分布拟合的SPSS卡方检验与K-S检验

- 2.3.1 实验目的
- 2.3.2 基本原理
- 2.3.3 实验数据及内容
- 2.3.4 操作步骤及结果
- 2.3.5 结果分析

## 2.4 损失分布的随机模拟

- 2.4.1 实验目的
- 2.4.2 基本原理
- 2.4.3 实验数据及内容
- 2.4.4 操作步骤与结果

## 2.5 损失分布的贝叶斯估计

- 2.5.1 实验目的
- 2.5.2 基本原理
- 2.5.3 实验数据及内容
- 2.5.4 操作步骤与结果

## <<风险管理计算与建模>>

### 第3章 损失估计

#### 3.1 损失次数频率的二项分布估计

- 3.1.1 实验目的
- 3.1.2 基本原理
- 3.1.3 实验数据及内容
- 3.1.4 操作步骤及结果

#### 3.2 损失金额频率的正态估计

- 3.2.1 实验目的
- 3.2.2 基本原理
- 3.2.3 实验数据及内容
- 3.2.4 操作步骤及结果

#### 3.3 总损失频率的分析计算

- 3.3.1 实验目的
- 3.3.2 基本原理
- 3.3.3 实验数据及内容
- 3.3.4 操作步骤及结果

### 第4章 风险管理决策

#### 4.1 期望损益准则决策

- 4.1.1 实验目的
- 4.1.2 基本原理
- 4.1.3 实验数据与内容
- 4.1.4 操作步骤与结果

### 第5章 信用风险管理

#### 5.1 个人信用综合评分与授信决策模型

- 5.1.1 实验目的
- 5.1.2 基本原理
- 5.1.3 实验数据与内容
- 5.1.4 操作步骤与结果

#### 5.2 企业财务综合评价模型

- 5.2.1 实验目的
- 5.2.2 基本原理
- 5.2.3 实验数据与内容
- 5.2.4 操作步骤与结果

#### 5.3 违约回归分析模型

- 5.3.1 实验目的
- 5.3.2 基本原理
- 5.3.3 实验数据与内容
- 5.3.4 操作步骤与结果

#### 5.4 KMV模型

- 5.4.1 实验目的
- 5.4.2 基本原理
- 5.4.3 实验数据与内容
- 5.4.4 操作步骤与结果

#### 5.5 信用风险损失的计算

- 5.5.1 实验目的
- 5.5.2 基本原理
- 5.5.3 实验数据与内容

## <<风险管理计算与建模>>

5.5.4 操作步骤与结果

5.6 应收账款信用政策决策模型

5.6.1 实验目的

5.6.2 基本原理

5.6.3 实验数据及内容

5.6.4 操作步骤与结果

第6章 市场风险管理

6.1 久期与凸度的计算与应用

6.1.1 实验目的

6.1.2 基本原理

6.1.3 实验数据与内容

6.1.4 操作步骤与结果

6.2 资产负债组合的久期分析与免疫管理

6.2.1 实验目的

6.2.2 基本原理

6.2.3 实验数据与内容

6.2.4 操作步骤与结果

6.3 风险价值计算的方差—协方差法

6.3.1 实验目的

6.3.2 基本原理

6.3.3 实验数据与内容

6.3.4 操作步骤与结果

6.4 风险价值计算的历史模拟法

6.4.1 实验目的

6.4.2 基本原理

6.4.3 实验数据与内容

6.4.4 操作步骤与结果

6.5 股票系数的计算

6.5.1 实验目的

6.5.2 基本原理

6.5.3 实验数据与内容

6.5.4 操作步骤与结果

6.6 期货套期保值

6.6.1 实验目的

6.6.2 基本原理

6.6.3 实验数据与内容

6.6.4 操作步骤与结果

6.7 期权价格敏感性指标的计算与分析

6.7.1 实验目的

6.7.2 基本原理

6.7.3 实验数据与内容

6.7.4 操作步骤与结果

6.8 期权价值影响因素的敏感性分析

6.8.1 实验目的

6.8.2 基本原理

6.8.3 实验数据与内容

6.8.4 操作步骤与结果

## <<风险管理计算与建模>>

### 6.9 投资组合保险

- 6.9.1 实验目的
- 6.9.2 基本原理
- 6.9.3 实验数据与内容
- 6.9.4 操作步骤与结果

### 第7章 操作风险管理

#### 7.1 操作风险价值估计的损失分布法

- 7.1.1 实验目的
- 7.1.2 基本原理
- 7.1.3 实验数据与内容
- 7.1.4 操作步骤与结果

#### 7.2 操作风险经济资本计算的标准法

- 7.2.1 实验目的
- 7.2.2 基本原理
- 7.2.3 实验数据与内容
- 7.2.4 操作步骤与结果

### 第8章 流动性风险管理

#### 8.1 现金需求的销售百分比法预测

- 8.1.1 实验目的
- 8.1.2 基本原理
- 8.1.3 实验数据与内容
- 8.1.4 操作步骤与结果

#### 8.2 现金需求的资金特性分析法预测

- 8.2.1 实验目的
- 8.2.2 基本原理
- 8.2.3 实验数据与内容
- 8.2.4 操作步骤与结果

#### 8.3 现金预算

- 8.3.1 实验目的
- 8.3.2 基本原理
- 8.3.3 实验数据与内容
- 8.3.4 操作步骤与结果

### 第9章 资本预算

#### 9.1 监管资本的标准法计算

- 9.1.1 实验目的
- 9.1.2 基本原理
- 9.1.3 实验数据与内容
- 9.1.4 操作步骤与结果

#### 9.2 监管资本的内部评级法计算

- 9.2.1 实验目的
- 9.2.2 基本原理
- 9.2.3 实验数据与内容
- 9.2.4 操作步骤与结果

### 参考文献

## <<风险管理计算与建模>>

### 编辑推荐

《风险管理计算与建模》全面地讲解了：风险管理计算与建模原理，并安排了大量的实例，详尽地介绍了风险管理计算与建模的软件实现。

全书分为三个部分：第1章至第4章为第一部分，主要介绍了风险管理计算与建模的一般原理，包括波动率的计算、损失分布的拟合与模拟、损失估计、风险管理决策；第5章至第8章为第二部分，具体地介绍各种金融风险的计算分析与建模方法及其软件实现，包括信用风险、市场风险、操作风险、流动性风险等；第9章为第三部分，则是从全面风险管理的视角介绍企业资本预算的基本原理与预算方法。

<<风险管理计算与建模>>

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>