第一图书网, tushu007.com

<<金融机构现代风险管理基本框架>>

图书基本信息

书名：<<金融机构现代风险管理基本框架>>

13位ISBN编号：9787504940940

10位ISBN编号：7504940941

出版时间：2006-8

出版时间：中国金融出版社

作者：陈忠阳

页数：426

字数：381000

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

本书分析了现代风险理念，阐述了风险和风险管理的基本性质和总体框架，对市场风险、信用风险和操作风险及其管理做了专门分析，构建了现代风险管理框架的技术支柱，在此基础上，结合“巴塞尔新资本协议”，深入分析了现代风险管理对我国的影响和启示。
本书适用于高等学校经济类专业学生，对金融从业人员和理论研究人员也大有裨益。

作者简介

陈忠阳，现任中国人民大学财政金融学院应用金融系副教授、副系主任，金融风险管理工作室主任，美国芝加哥伊利诺依大学(University of Illinois at Chicago)商学院金融系兼职教授，“中国金融风险经理(年度)论坛”发起者和组织者。
曾获得中国人民大学学士(专业为价格学)、硕士

书籍目录

导言第一章 市场经济中的风险角色 第一节 风险选择：风险承担者还是规避者 第二节 风险偏好选择：风险爱好者、中立者还是厌恶者 第三节 风险交易行为选择：投机者、投资者还是赌博者第二章 风险的概念和性质分析 第一节 风险的定义和相关概念辨析 第二节 风险的分类 第三节 风险的性质分析 第四节 经济制度与风险第三章 金融机构风险管理的性质 第一节风险管理的本质和目标 第二节 承担和管理风险是金融机构的基本职能 第三节 风险管理与金融机构的价值和核心竞争力 第四节 驳风险管理“冲突论”和“花瓶论”第四章 金融机构风险管理的基本策略和机制 第一节 基本策略 第二节 基本机制 第三节 一个策略和机制失败的案例：中航油巨亏 第四节 保险公司风险管理特征比较分析第五章 市场风险管理 第一节 市场风险的性质和发展 第二节 敏感度分析 第三节 在险价值分析 第四节 衍生产品和金融工程在市场风险管理中的应用 第五节 期货对冲及其基差风险 第六节 相对风险和跟踪误差第六章 信用风险管理 第一节 信用风险管理的性质和发展 第二节 信用风险分析与衡量的方法体系 第三节 信用风险量化模型 第四节 违约损失率的分析方法 第五节 信用组合管理 第六节 信用风险转移第七章 操作风险管理 第一节 操作风险及其管理的性质 第二节 操作风险管理的基本框架 第三节 操作风险的评估和量化 第四节 操作风险管理的策略和方法第八章“巴塞尔新资本协议”与我国银行风险管理 第一节“巴塞尔新资本协议”及其对我国的影响 第二节 中国是在拒绝还是在接受“巴塞尔新资本协议” 第三节 让银行资本发挥它的作用第九章 现代金融机构风险管理对我国的启示 第一节 我国金融机构风险管理的环境变化 第二节 我国金融机构风险管理困境的一个案例：管理提前还贷风险 第三节 风险管理有效性和我国金融机构风险管理“长效机制”问题 第四节 现代金融机构风险管理十大原则参考文献后记

第一图书网, tushu007.com

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