

<<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：9787509532355

10位ISBN编号：7509532353

出版时间：2012-1

出版时间：中国财政经济出版社一

作者：杜慧芬，杨筱燕 主编

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>

## <<金融风险管理>>

### 内容概要

《金融风险管理》是财政部规划本科教材中的一本。在介绍金融风险管理的基本理论和基本方法的基础上，对各金融机构、金融业务和金融产品的风险计量与管理进行了重点阐述，同时吸收了当前金融风险管理领域的最新管理课题、案例和实证成果，以求最大程度地满足风险管理领域专业人才培养的要求。

<<金融风险管理>>

书籍目录

第一部分 理论方法篇

第一章 金融风险管理概述

- 第一节 金融风险的定义与特征
- 第二节 金融风险管理的内涵和目的
- 第三节 金融风险管理的组织结构
- 第四节 金融风险管理的流程
- 第五节 资本管理与风险调整收益

第二章 市场风险度量

- 第一节 波动性
- 第二节 敏感性
- 第三节 VaR及VaR拓展
- 第四节 VaR计算
- 第五节 事后检验

附录 VaR事后检验实例

第三章 信用风险度量

- 第一节 信用风险要素
- 第二节 信用风险评估与测度

附录 KMV与CreditMetrics信用风险模型应用实例

第四章 操作风险度量

- 第一节 操作风险量化管理
- 第二节 操作风险度量的内部度量法
- 附录一 操作风险LDA方法实现
- 附录二 业务操作风险损失预测实例

.....

第二部分 实践篇

第三部分 风险案例篇

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>