

<<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：9787514101690

10位ISBN编号：7514101691

出版时间：2011-3

出版时间：经济科学出版社

作者：安起光，冯玉梅 著

页数：215

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

《山东省成人高等教育财经类品牌专业系列教材：金融风险管理》系统地阐述了金融风险的种类，各类金融风险的识别、度量和和管理方法。

为了做到理论与实际相结合，本教材既有对基本理论与基本原理的阐述，又有对实务情节的介绍和分析。

在教材编写体例上，充分考虑了成人教育的特点，按照教学目的、基本理论与基本原理、专题研讨、案例分析、习题思考的顺序编写。

## 书籍目录

第1章 金融风险与金融风险管理概述学习目标基本理论与基本原理1.1 金融风险概述1.2 金融风险管理概述专题研讨专题1.1 风险管理与企业纳税成本案例分析案例1.1 次贷危机面前的美国花旗银行与摩根大通银行习题思考第2章 金融风险管理的数理基础学习目标基本理论与基本原理2.1 矩阵、线性方程组和最优化2.2 概率论与统计学基础专题研讨专题2.1 马柯威茨 (Markowitz) 与投资组合选择案例分析案例2.1 拯救华尔街：长期资本管理公司的崛起与陨落习题思考第3章 信用风险管理学习目标的基本理论与基本原理3.1 信用风险概述3.2 信用风险的度量3.3 信用风险的管理专题研讨专题3.1 我国企业债券的信用风险与监控案例分析案例3.1 掌控企业基本信息是信用风险控制的基础习题思考第4章 市场风险管理学习目标的基本理论与基本原理4.1 市场风险概述4.2 市场风险的辨识与度量4.3 市场风险的管理方法专题研讨专题4.1 我国商业银行的市场风险管理案例分析案例4.1 海南发展银行的关闭习题思考第5章 操作风险管理学习目标基本理论与基本原理5.1 操作风险概述5.2 操作风险的度量5.3 操作风险的评估与控制专题研讨专题5.1 操作风险的高级衡量法专题5.2 风险缓释案例分析案例5.1 商业银行内部欺诈案例案例5.2 某分理处发生多功能借记卡自助质押贷款诈骗案习题思考第6章 流动性风险管理学习目标基本理论与基本原理6.1 流动性风险概述6.2 流动性风险的度量6.3 流动性风险管理方法专题研讨专题6.1 流动性风险管理面临的新挑战案例分析案例6.1 英国诺森罗克银行挤兑事件透视习题思考第7章 其他风险管理学习目标基本理论与基本原理7.1 声誉风险管理7.2 战略风险管理专题研讨专题7.1 商业银行声誉风险的主要情形专题7.2 战略风险管理因素及其方法案例分析案例7.1 民生银行声誉风险管理习题思考第8章 风险损失与资本配置学习目标基本理论与基本原理8.1 风险损失和资本的概念8.2 经济资本的配置专题研讨专题8.1 信用风险经济资本计算范例习题思考第9章 金融风险的监管学习目标基本理论与基本原理9.1 金融风险监管的理论基础9.2 金融风险监管与市场约束9.3 金融风险监管体制专题研讨专题9.1 商业银行风险监管指标案例分析案例9.1 中国银行纽约分行事件和王雪冰案习题思考主要参考文献

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>