

<<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：9787542917881

10位ISBN编号：7542917889

出版时间：2006-12

出版时间：立信会计出版社

作者：谷秀娟

页数：351

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

本书运用现代金融理论与计量方法，系统深入地研究了利率风险、市场风险、信用风险与操作风险的识别、度量和管理的模型、方法。

通过阅读本书，读者能够掌握当今国际领先机构金融风险管理的模型和方法，把握现代金融理论的发展主线和核心内容。

全书共分为10章。

第1章到第4章系统介绍了金融风险的内涵和分类、现代金融理论和计量方法；第5章到第9章详细分析了利率风险、市场风险、信用风险与操作风险的度量和管理的模型、方法；第10章深入探讨了全面风险管理问题。

本书的阅读对象包括经济、金融和管理类的研究者、教师、学生、金融从业者和监管者。

#### 作者简介

谷秀娟，女，教授（河南工业大学经贸学院），博士，1968年出生。  
1989年在中国人民大学计划统计学院获经济学学士学位，1990年在中美经济培训中心学习，1992年在中国人民大学财政金融学院获经济学硕士学位，1999～2000年参加教育部和北京市政府合作的“跨世纪人才项目”，作为

## 书籍目录

第1章 金融风险管理概述 1.1 金融风险的含义与特点 1.2 金融风险管理的流程与策略 1.3 金融风险管理的基本理论与技术发展 本章小结第2章 估值基础 2.1 资金的时间价值 2.2 单一证券的收益与风险 本章小结第3章 证券的风险与定价 3.1 有效市场假说 3.2 证券组合理论 3.3 资本资产定价模型 3.4 多变量和因素分析定价模型 3.5 套利定价理论 本章小结第4章 期权定价理论与投资策略 4.1 期权的到期日价值 4.2 期权价值的一般规律 4.3 对冲头寸的二项式期权定价 4.4 布莱克-斯科尔斯期权模型 4.5 期权交易的投资策略 本章小结第5章 利率风险管理 5.1 利率风险的分类 5.2 利率风险的衡量 5.3 久期模型 5.4 利率期货 5.5 利率期权 5.6 利率互换 本章小结第6章 市场风险的度量 6.1 市场风险测度的在险价值方法 6.2 非参数VAR与参数VAR 6.3 金融工具在险价值的计算 6.4 在险价值的测定方法 6.5 边际VAR、成分VAR和增量VAR 6.6 市场风险的监管度量模型：巴塞尔委员会的标准化模型 本章小结第7章 在险价值方法的应用 7.1 运用在险价值进行风险的度量与控制 7.2 运用在险价值进行积极风险管理 本章小结第8章 信用风险管理 8.1 信用风险的本质 8.2 违约风险 8.3 信用风险暴露 8.4 信用风险度量与管理 8.5 Credit Metrics模型 8.6 Credit Risk + 模型 8.7 信用风险的组合模型 8.8 信用悖论及其解决 本章小结第9章 操作风险管理 9.1 操作风险的重要性 9.2 操作风险的概念 9.3 操作风险的度量 9.4 操作风险的管理 本章小结第10章 全面风险管理 10.1 风险体系 10.2 事件风险 10.3 全面风险管理 10.4 金融风险管理的意义 本章小结参考文献后记

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>