

<<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：9787301200902

10位ISBN编号：7301200900

出版时间：2012-2

出版时间：北京大学出版社

作者：朱淑珍 编

页数：299

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》根据金融风险管理知识的内在逻辑，全面系统地介绍金融风险管理的理论和实践活动。

《金融风险管理》共分14章，第1、2章分别介绍了金融风险和金融风险管理的概念和理论；第3章为金融风险的识别、度量与预测；第4章为金融风险管理战略及策略；第5章讨论了商业银行的监管与新巴塞尔协议；第6~14章，从信用、流动性、利率、汇率、操作、股票市场、债券与基金市场、金融衍生产品和保险、金融信托与租赁9类金融风险的角度，阐述了金融风险管理的具体应用。

《金融风险管理》可作为高等院校金融学专业、经济类与管理类专业的本科和研究生教材，也适合金融从业人员以及自学者参考使用。

书籍目录

第1章 金融风险概述

- 1.1 金融风险
 - 1.1.1 金融风险的概念
 - 1.1.2 对金融风险的正确理解
- 1.2 金融风险的特征
 - 1.2.1 金融风险的一般特征
 - 1.2.2 金融风险的当代特征
- 1.3 金融风险的种类
 - 1.3.1 根据金融风险的形态划分
 - 1.3.2 根据金融风险的主体划分
 - 1.3.3 根据金融风险的产生根源划分
 - 1.3.4 根据金融风险的性质划分
 - 1.3.5 根据金融风险的层次划分
- 1.4 金融风险的经济效应
 - 1.4.1 微观经济效应
 - 1.4.2 宏观经济效应
- 1.5 金融风险形成的一般理论
 - 1.5.1 金融风险的形成机理
 - 1.5.2 金融风险形成的理论探讨
- 本章小结
- 习题

第2章 金融风险管理基本理论

- 2.1 金融风险管理的意义与分类
 - 2.1.1 金融风险管理的概念
 - 2.1.2 金融风险管理的意义
 - 2.1.3 金融风险管理的分类
- 2.2 金融风险管理的特征、目标和手段
 - 2.2.1 金融风险管理的特征
 - 2.2.2 金融风险管理的目标
 - 2.2.3 金融风险管理的手段
- 2.3 金融风险管理体制
 - 2.3.1 金融风险管理系统
 - 2.3.2 金融风险管理的组织体系
- 2.4 金融风险管理的演进及一般程序
 - 2.4.1 金融风险管理演进的主要表现
 - 2.4.2 金融风险管理的一般程序
- 本章小结
- 习题

第3章 金融风险的识别、度量与预测

- 3.1 金融风险的识别
 - 3.1.1 金融风险识别概述
 - 3.1.2 金融风险识别的原则与方法
- 3.2 金融风险的度量

<<金融风险管理>>

- 3.2.1 金融风险度量概述
- 3.2.2 金融风险度量的方法与工具
- 3.3 金融风险的预测
 - 3.3.1 基本要素分析法
 - 3.3.2 技术分析法
- 本章小结
- 习题

第4章 金融风险管理战略及策略

- 4.1 金融风险管理战略
 - 4.1.1 金融风险管理战略的含义和特征
 - 4.1.2 金融风险管理的基本战略
- 4.2 金融风险管理策略
 - 4.2.1 金融风险管理策略的基本类型
 - 4.2.2 金融风险管理策略的选择原则
- 4.3 中国金融风险管理现状
 - 4.3.1 中国金融风险的形成原因
 - 4.3.2 中国当前金融风险管理的特点
- 本章小结
- 习题

第5章 商业银行的监管与新巴塞尔协议

- 5.1 商业银行的监管
 - 5.1.1 市场准入监管
 - 5.1.2 日常经营监管
 - 5.1.3 市场退出监管
- 5.2 新巴塞尔协议
 - 5.2.1 1988年的巴塞尔协议I
 - 5.2.2 巴塞尔协议
 - 5.2.3 2010年的巴塞尔协议
- 本章小结
- 习题

第6章 信用风险管理

- 6.1 信用风险概述
 - 6.1.1 商业银行信用风险的含义及特点
 - 6.1.2 商业银行信用风险产生的原因
- 6.2 内部评级法
 - 6.2.1 内部评级法的体系结构
 - 6.2.2 内部评级法的基本要素
 - 6.2.3 商业银行信用风险管理 with 实施内部评级法的关系
- 6.3 传统信用风险的度量
 - 6.3.1 专家评定方法
 - 6.3.2 Z评分模型和ZETA评分模型
- 6.4 现代信用风险的度量
- 本章小结
- 习题

<<金融风险管理>>

第7章 流动性风险管理

7.1 流动性风险概述

7.1.1 流动性

7.1.2 流动性风险

7.1.3 流动性风险的成因

7.2 流动性风险管理理论

7.2.1 资产管理理论

7.2.2 负债管理理论

7.2.3 资产负债综合管理理论

7.2.4 资产负债表内表外统管理理论

7.3 流动性风险的度量

7.3.1 度量流动性风险的财务比率

7.3.2 度量流动性风险的市场信息指标

7.4 流动性风险管理方法

7.4.1 衡量流动性缺口

7.4.2 提供流动性供给

本章小结

习题

第8章 利率风险管理

8.1 利率风险概述

.....

第9章 汇率风险管理

第10章 操作风险管理

第11章 股票市场风险管理

第12章 债券与基金市场风险管理

第13章 金融衍生产品风险管理

第14章 保险、金融信托与租赁风险

参考文献

编辑推荐

知识实用求新，阐释金融风险管理新理念 选材精益求精，反应业界学科前沿新动态 习题
丰富多彩，巩固所学拓展实践新视角 丛书特点： 1. 科学实用：面向应用型人才就业，具备
大量当前实用案例，注重培养学生实践能力 2. 内容新颖：借鉴国内外最新教材，融会当前最新
理论，遵循最新发布的各项准则、规范 3. 系列完整：把握财经管理专业相关学科、课程之间
的关系，整个系列体系严密完整 4. 方便教学

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>