

<<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：9787302296362

10位ISBN编号：7302296367

出版时间：2012-8

出版时间：清华大学出版社

作者：高晓燕 编

页数：262

字数：393000

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

高晓燕等编著的《金融风险管理》通过运用最新的风险分析工具，对信用风险、流动性风险、市场风险、利率风险、汇率风险、证券投资基金风险、操作风险、法律风险及其他风险的风险管理等进行了系统分析，并提出相应的定价模型和风险管理模型。

对金融风险管理的发展环境及未来发展趋势进行了研究。

论述了金融风险管理的基本结构、程序、技能要求和管理模型；梳理了基本的、国际上通用的金融风险识别、衡量技术。

对金融风险管理进行了全面系统的分析研究。

《金融风险管理》力求突出几个特色：系统性，新颖性，现实性。

本书适合经济管理类专业本科生、专科生使用，适合做银行从业资格考试的学员培训教材。

# <<金融风险管理>>

## 书籍目录

### 第一章 金融风险管理概述

#### 第一节 金融风险概论

- 一、金融风险的概念
- 二、金融风险的分类
- 三、金融风险的特点
- 四、金融风险的产生原因
- 五、我国金融风险产生的特殊原因

#### 第二节 金融风险管理的内涵、意义及其发展

- 一、金融风险管理的内涵
- 二、金融风险管理的意义
- 三、金融风险管理的发展

#### 第三节 金融风险的监督管理

- 一、金融风险监管的理论根源及其有效性的争论
- 二、金融风险监管的目标和原则
- 三、金融风险监管体制

案例分析广东省国际信托投资公司的破产

思考题

### 第二章 金融风险管理的框架

#### 第一节 金融风险管理系统

- 一、金融风险管理的衡量系统
- 二、金融风险管理的决策系统
- 三、金融风险管理的预警系统
- 四、金融风险管理的监控系统
- 五、金融风险管理的补救措施
- 六、金融风险管理的评估系统
- 七、金融风险管理的辅助系统

#### 第二节 金融风险管理的组织结构

- 一、金融机构风险管理组织结构设计的基本原则
- 二、金融机构风险管理的组织体系
- 三、风险管理的组织结构模式
- 四、实例分析：我国国有控股商业银行风险管理组织结构

#### 第三节 金融风险管理的一般程序

- 一、金融风险的识别与分析
- 二、风险评估
- 三、风险管理对策的选择和实施方案的设计
- 四、金融风险管理方案的实施
- 五、风险报告
- 六、风险管理的评估
- 七、风险确认和审计

案例分析行长挪用巨额公款炒股本金无归

思考题

### 第三章 利率风险的管理

#### 第一节 利率风险概述

- 一、利率风险的分类
- 二、影响利率风险的因素

## <<金融风险管理>>

### 三、利率风险的成因分析

#### 第二节 利率风险的衡量

- 一、利率期限结构
- 二、持续期
- 三、凸性

#### 第三节 利率风险的管理

- 一、利率风险管理的含义
- 二、利率风险管理的必要性
- 三、利率风险管理的重点
- 四、利率风险管理的方法

#### 第四节 我国的利率风险管理

- 一、我国利率风险控制与管理的有关问题
- 二、我国商业银行利率风险控制方略
- 三、我国商业银行利率风险衡量方法

#### 案例分析发生在美国奎克国民银行的故事

#### 思考题

### 第四章 汇率风险的管理

#### 第一节 汇率风险概述

- 一、汇率风险的概念
- 二、汇率风险的成因分析
- 三、汇率风险的影响

#### 第二节 汇率风险的类型

#### 第三节 汇率风险衡量

- 一、净外汇风险敞口
- 二、汇率风险衡量

#### 第四节 汇率风险的管理

- 一、汇率风险管理原则
- 二、汇率风险的管理战略
- 三、汇率风险的控制
- 四、我国汇率风险管理的现状、存在问题、发展方向

#### 案例分析汇率风险案例

#### 思考题

### 第五章 金融衍生工具及其风险管理

#### 第一节 金融衍生工具概述

- 一、金融衍生工具的概念和特征
- 二、金融衍生工具的分类
- 三、金融衍生工具的主要功能
- 四、金融衍生工具的产生与发展动因

#### 第二节 金融衍生工具的定价与风险度量

- 一、金融衍生工具的定价
- 二、风险度量

#### 第三节 衍生金融工具的风险管理

- 一、金融衍生工具的风险类型
- 二、风险管理的目标
- 三、金融衍生工具风险的管理
- 四、我国金融衍生产品的风险管理

#### 案例分析金融衍生产品交易案例

## <<金融风险管理>>

### 思考题

#### 第六章 证券投资基金组合风险管理

##### 第一节 资产组合理论

- 一、证券收益率和风险的测定
- 二、影响证券组合风险的因素
- 三、证券投资风险的概述
- 四、现代资产组合理论
- 五、无风险借贷对有效集的影响
- 六、现代证券投资基金组合理论的局限性
- 七、资产组合管理理论对中国的现实意义

##### 第二节 资本资产定价理论

- 一、资本资产定价模型的假设
- 二、分离定理
- 三、市场组合
- 四、资本市场线(cML)
- 五、证券市场线(sML)
- 六、资本市场线和证券市场线的关系
- 七、 $\beta$ 系数
- 八、资本资产定价模型的扩展
- 九、资本资产定价模型的意义

##### 第三节 指数模型与套利定价理论

- 一、指数模型
- 二、套利定价理论
- 三、我国的证券投资基金组合风险管理的现状及存在的问题
- 四、针对我国证券市场的现状提出的措施

#### 案例分析长期资本管理公司的兴衰及启示

### 思考题

#### 第七章 流动性风险的管理

##### 第一节 流动性风险概述

- 一、流动性风险的内涵
- 二、流动性风险的特征
- 三、流动性风险的作用

##### 第二节 流动性风险管理理论

- 一、资产管理理论
- 二、负债管理理论
- 三、资产负债综合管理理论

##### 第三节 流动性风险的衡量

- 一、流动性比率或指标
- 二、现金流分析
- 三、其他衡量方法

##### 第四节 流动性风险的管理技术

- 一、流动性风险的识别
- 二、流动性风险的预警
- 三、压力测试
- 四、情景分析

#### 案例分析海南发展银行的关闭

### 思考题

## <<金融风险管理>>

### 第八章 信用风险管理

#### 第一节 信用风险概述

- 一、信用风险的概念
- 二、信用风险的来源
- 三、信用风险的类型
- 四、信用风险的影响因素
- 五、信用风险的特征
- 六、我国信用风险的特点

#### 第二节 信用风险度量方法

- 一、传统的信用风险度量方法
- 二、现代信用风险度量模型

#### 第三节 信用风险管理方法

- 一、信用风险管理方法的演变
- 二、信用风险管理方法
- 三、现代信用风险的管理手段
- 四、现代信用风险管理的发展趋势

#### 第四节 我国信用风险管理现状

- 一、我国国有商业银行的风险特征
- 二、我国商业银行信用风险内部评级的现状和问题
- 三、完善我国商业银行信用风险内部评级体系的建议

#### 案例分析从次贷危机到全球金融危机

#### 思考题

### 第九章 操作风险管理

#### 第一节 操作风险概述

- 一、操作风险的定义
- 二、操作风险的特点

#### 第二节 操作风险的管理

- 一、加强防范操作风险的对策
- 二、操作风险管理的任务和原则
- 三、我国商业银行操作风险的管理实践

#### 第三节 商业银行操作风险的案例分析

- 一、国际操作风险案例介绍
- 二、国内操作风险案例介绍
- 三、案例分析的启示：如何防范操作风险

#### 案例分析法国兴业银行巨亏

#### 思考题

### 第十章 其他风险管理

#### 第一节 法律风险管理的概述

- 一、法律风险及其管理的定义
- 二、构建法律风险防范机制的现实意义
- 三、法律风险的具体防控措施

#### 第二节 声誉风险管理

- 一、声誉风险的定义及形式
- 二、加强声誉风险管理的意义
- 三、声誉风险管理存在的困难
- 四、声誉风险管理的有效措施

#### 案例分析“吴英神话”：法律背后的乱象

## <<金融风险管理>>

### 思考题

#### 第十一章 金融风险管理的未来

##### 第一节 金融风险管理发展趋势

- 一、培育风险管理文化
- 二、重构风险管理体制
- 三、提升风险管理技术

##### 第二节 《巴塞尔新资本协议》

- 一、巴塞尔协议的发展历程
- 二、巴塞尔新协议的主要内容
- 三、巴塞尔资本协议与商业银行风险管理
- 四、巴塞尔协议在中国

##### 案例分析《巴塞尔协议》的进展及其影响

### 思考题

#### 附录A

#### 附录B 中国银监会关于印发《商业银行操作风险管理指引》的通知

#### 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>