

<<风险管理>>

前言

风险是影响金融决策行为的基本要素，如果不存在风险，用以有效分配资源的金融体系就会变得相当简单。

在一个无风险的世界中，只需要存在少数几个机构和少量几种工具就可以了，而且，金融业务所需要的分析工具也会变得相当简化。

当然，在现实生活中，风险总是无处不在。

而且，我们在现实生活中所看到的金融体系最基本的作用也就在于有效地分配风险。

家庭、企业、政府以及金融机构所作的种种金融决策也主要集中在对风险的管理上。

测度风险的影响，并选择对其加以控制和分散的方法，需要用到很复杂的数学和计算工具。

事实上，现代金融实践中所用到的数学模型采用了许多相当复杂的数学方法。

<<风险管理>>

内容概要

本书全面囊括市场风险、信用风险与操作风险，综合的VaR分析框架，降低风险的对冲策略，作者将风险管理的整个领域融为一体，从政策、方法论到数据、技术框架，介绍了综合性的风险管理、监管环境、资本分配、实际的度量问题以及未来的思考等。本书涵盖了投资对冲策略，将创新性衍生品、信用风险以及证券化技术等内容化为一部无所不包的、易于接受的参考指南。

作者简介

米歇尔·科罗赫，博士，加拿大帝国商业银行风险管理部高级副总裁、全球分析师，负责市场及信用风险分析。

在学术期刊上著述颇多，现任《衍生品》以及《银行与金融》杂志的副编辑，还是《风格》的编委会成员。

丹·加莱博士，希伯来大学金融管理教授，SigmaP.C.M股东。

加莱博士为芝加哥期权交易所以及美国股票交易所提供咨询服务，并在领先杂志上发表了大量文章。他是芝加哥期权交易所首届Pomeranze奖获得者，该奖用于表彰期权研究方面的卓越成果。

罗伯特·马克，博士，加拿大帝国商业银行高级执行副总裁、首席风险官，直接向银行的主席和CEO汇报。

马克博士是加拿大帝国商业银行高级执行团队成员，1998年被任命为全球风险师协会财务风险管理者。

<<风险管理>>

书籍目录

前言绪论序言第1章 风险管理体系的必要性1. 引言2. 历史演进3. 监管环境4. 学术背景与技术变迁5. 会计体系与风险管理体系6. 最近的金融危机所带来的教训7. 风险敞口的分类8. 非金融机构的风险管理体系第2章 管制方面的新动向的公司环境1. 引言2. 30人小组 (G-30) 的政策建议3. 1988年巴塞尔协议4. “1996年修正案”或“1998年巴塞尔协议”5. 2000巴塞尔协议第3章 银行风险管理程序的设计和管理1. 引言2. 风险管理的组织：3支柱框架3. 数据和技术性设施4. 风险授权和风险控制5. 建立资产负债缺口的风险限额和流动性管理6. 结语：通往成功的步骤第4章 新巴塞尔协议对金融风险的资本要求1. 引言2. 标准化方法3. 内部建模方法4. 标准化模型和内部模型方法的劫持和反对意见：一个新的建议——“预留方法”5. 根据标准经方法和内部建模方法计算出的资本要求比较第5章 测度市场风险：VaR方法1. 引言2. 测度风险：一个历史视角3. 在险价值的界定4. 在险价值的计算5. 在险价值的计算附录：债券的持续期和凸性第6章 测度市场风险：VaR方法的扩展以及模型检验第7章 信用评级体系第8章 衡量信用风险的信用转移方法第9章 用于衡量信用风险的或有求偿法第10章 其他方法——衡量信用风险的实际的和简化形式的方法第11章 对各行业开发的信用模型比较以及相关测试问题第12章 信用风险的套期第13章 管理操作风险第14章 资本分配与业绩评估第15章 模型风险第16章 非银行机构的风险管理第17章 未来的风险管理

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>