

<<金融风险与管理>>

图书基本信息

书名：<<金融风险与管理>>

13位ISBN编号：9787504962119

10位ISBN编号：7504962112

出版时间：2012-1

出版时间：中国金融出版社

作者：卢亚娟 主编

页数：235

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>

<<金融风险与管理>>

内容概要

本书总共分为三大部分共十一章。

第一部分是基础篇，主要阐述金融风险以及金融风险管理的基本原理，包括第一章到第三章的相关内容。

第一章主要对金融风险的内涵及特征进行了分析，并进一步分析了金融风险的效应以及金融风险形成的内在机理。

第二章介绍了金融风险辨识与度量的内容及基本方法。

第三章则对金融风险管理的一般性原理进行了介绍，并建议探讨金融风险管理的流程及方法。

第二部分是风险篇，具体阐述了商业银行在经营过程中面临的四大风险，包括第四章到第七章的内容，各章分别对信用风险、市场风险、操作风险与流动性风险的管理和计量方法进行了系统的讲解。

第三部分是监管篇，其中第八章重点介绍商业银行内部控制的内涵及基本框架，并结合商业银行内部控制评价方法探讨了基于ERM的商业银行内部控制体系的构建。

第九章对金融监管的含义、目标、原则及体制进行讲述。

第十章和第十一章则具体对银行业监管以及农村信用社监管进行了阐述。

<<金融风险与管理>>

作者简介

卢亚娟，女，1966年11月生，江苏宜兴人，南京审计学院金融学院副院长，教授，博士，从事区域金融和农村金融研究。

现为北京地方金融论坛专家委员会委员，江苏省金融学会理事，南京市金融学会理事，南京审计学院应用经济学硕士点“区域金融与区域经济”方向带头人，江苏省“六大人才高峰”培养对象，江苏省高校“青蓝工程”优秀中青年骨干教师，江苏省高校“青蓝工程”优秀学科梯队及江苏省高校“青蓝工程”科技创新团队（区域金融创新研究团队）核心成员。

长期从事货币银行学、金融风险管理、信用风险管理等课程的教学，先后在《经济学动态》《中国农村经济》《财贸经济》《数量经济技术经济研究》《江海学刊》等杂志公开发表专业论文40余篇，出版专著1部，参编教材5本，主持课题7项，其中省级3项，横向课题1项。

农信银资金清算中心是经中国人民银行批准，由全国31家省级农村合作金融机构（含农村商业银行）共同成立的全国性股份制支付清算服务企业。

农信银资金清算中心建设、运行的农信银支付清算系统、农信银八大共享系统（电子商业汇票，网上银行、网上支付跨行清算、异地灾备、自助服务、手机银行、银行卡、远程学习）.目前已经成为联通全国近8万家农村合作金融机构网点的桥梁和纽带，对提升全国农村合作金融机构支付结算服务水平，提高整体竞争实力，以及服务“三农”发挥了不可替代的重要作用。

<<金融风险与管理>>

书籍目录

第一章 金融风险概述

第一节 金融风险的概念与种类

- 一、风险的含义
- 二、金融风险的含义
- 三、金融风险的特征
- 四、金融风险的类型

第二节 金融风险的效应分析

- 一、金融风险的微观经济效应
- 二、金融风险的宏观经济效应
- 三、金融风险的政治效应
- 四、金融风险的社会效应

第三节 金融风险的内在生成机理

- 一、金融机构的内在脆弱性理论
- 二、金融市场的内在脆弱性理论
- 三、金融风险的传染性理论
- 四、金融“脆弱—危机”的演化机理

第二章 金融风险辨识与度量

第一节 金融风险辨识的概念和原则

- 一、金融风险辨识的概念
- 二、金融风险辨识的基本原则

第二节 金融风险辨识的基本内容

- 一、金融风险辨识的基本要求
- 二、金融风险辨识的主要内容

第三节 风险辨识的基本方法

- 一、指标监控法
- 二、财务报表分析法
- 三、专家意见法
- 四、故障树分析法
- 五、风险度方法
- 六、风险值方法
- 七、层次分析法

第四节 风险度量的统计基础

- 一、均值
- 二、标准差
- 三、偏度
- 四、峰度
- 五、标准概率密度函数
- 六、相关系数与协方差

第三章 金融风险管理的基本原理

第一节 金融风险管理概述

- 一、金融风险管理的内涵和意义
- 二、金融风险管理的发展历程
- 三、金融风险管理的工程化特征

第二节 金融风险管理的流程

- 一、有效风险管理流程的评判标准

<<金融风险与管理>>

二、金融风险管理的流程

第三节 金融风险管理的的方法

一、金融风险管理的定性方法

二、金融风险管理的定量方法

第四节 我国金融风险管理策略

一、我国金融风险的表现形式与金融风险管理产生的根源

二、我国金融风险管理的策略研究

第四章 信用风险与管理

第一节 信用风险概述

一、信用风险的含义

二、信用风险的分类

三、信用风险产生的一般原因

第二节 信用风险的识别

一、单一法人客户信用风险的识别

二、集团客户信用风险识别

三、个人客户信用风险识别

第三节 信用风险的度量

一、客户信用评级

二、债项评级

.....

第五章 市场风险与管理

第六章 操作风险与管理

第七章 流动性风险与管理

第八章 商业银行内部控制

第九章 金融监管导论

第十章 银行业监管

第十一章 农村信用社监管体系

<<金融风险与管理>>

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>