

<<风险管理前沿>>

图书基本信息

书名：<<风险管理前沿>>

13位ISBN编号：9787300057347

10位ISBN编号：7300057349

出版时间：2004-1

出版时间：人民大学

作者：周大庆

页数：304

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>

## <<风险管理前沿>>

### 内容概要

本书以本土化内容为主，提供实例佐证理论，作者们通过团队合作的基础，将近年来风险管理中最主要、革命性的发展——风险价值，以深入浅出的方式，介绍与探讨该领域的理论，及其实作计算与评估。

作为岛内第一本以中文表达探讨风险价值的书籍，本书对于风险价值的理论发展、或实务应用、或即将执行的许多规范(如资本适足率)多有详尽的论述，而对于台湾环境的实证研究，则提供了学术研究者翻译教材外更宽广的空间。

作者将实作结果按部就班地加以介绍，对于在实务上需要应用风险价值系统来进行风险管理者存有莫大助益。

本书不仅可作为商学院高年级与研究所同学的教材，也可作为实务界和管理机构的参考依据。

<<风险管理前沿>>

作者简介

周大庆

现 职：“中华”开发工业银行顾问  
学 历：美国马萨诸塞州立大学数学硕士  
俄亥俄州立大学统计硕士  
乔治华盛顿大学经济博士

专长领域：衍生性金融产品·债券基金·资产组合管理·资产证券化·风险管理

沈大白

现 职：东吴大学会计系专任教授·东吴大学商学院研究室执行长  
学 历：美国杜兰大学财务经济博士

专长领域：会计揭露与盈余管理·财务金融风险

张大成

现 职：东吴大学国际贸易学系副教授  
学 历：台湾大学经济学博士  
专长领域：“国家”金融·衍生性金融商品

## &lt;&lt;风险管理前沿&gt;&gt;

## 书籍目录

第1章 绪论 第一节 风险值的概念 第二节 风险值的时代背景 第三节 风险的实务课题 第四节 风险值的重要性

第2章 风险与风险值 第一节 会计的风险管理方法 第二节 传统风险管理方法 第三节 风险值

第3章 风险值的规范 第一节 国际规范 第二节 资本充足率之计算 第三节 新巴塞尔资本协议 第四节 台湾规范

第4章 风险值衡量方法 第一节 量化风险值的功能 第二节 风险值基本原理 第三节 部分评价法 第四节 全额评价法 附录一 台湾地区风险值最适衰退因子研究 附录二 多变量蒙特卡罗计算模型

第5章 金融商品风险计算 第一节 金融商品与风险因子关系之建立 第二节 权益证券类金融商品 第三节 固定收益类金融商品 第四节 外汇型衍生性商品 附录一 现金流量拆解方法 附录二 浮动利率商品风险认定方式

第6章 回顾测试 第一节 回顾测试意义及方法 第二节 权益证券类商品实证内容及结果 第三节 汇率类商品实证内容及结果 第四节 固定收益类证券实证内容及结果 附录一 回顾测试汇整表(方法修正前) 附录二 回顾测试修正方案汇总

第7章 压力测试 第一节 压力测试功能及意义 第二节 压力测试的方法及说明 第三节 台湾地区压力情境研究 附录一 巴塞尔资本协议中压力测试规定(1996; section B?5) 附录二 整合性压力测试 附录三 事件研究方法说明

第8章 绩效评估与组合管理 第一节 风险资本与绩效评估 第二节 风险值的运用 第三节 风险报告及运用范例--ABC证券公司

第9章 风险值个案研究 第一节 操作衍生性金融商品失利个案探讨 第二节 岛内外运用风险值个案分析

第10章 其他风险值 第一节 信用风险值 第二节 操作风险值 第三节 资本风险值 第四节 盈余风险值暨现金流量风险值

第11章 衍生性金融商品与审查 第一节 衍生性金融商品交易与审计风险之关联 第二节 衍生性金融商品交易之内部控制 第三节 衍生性金融商品之审计 第四节 结论(代本书跋) 附录 相关网站

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>