

<<财金风险管理>>

图书基本信息

书名：<<财金风险管理>>

13位ISBN编号：9787300069180

10位ISBN编号：7300069185

出版时间：2005-10

出版单位：人民大学

作者：刘威汉

页数：394

字数：436000

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>

## <<财金风险管理>>

### 内容概要

本书尝试以新版巴塞尔协议为架构，分别就信用、利率、营运、衍生性金融商品，以及资产与负债之管理等主要领域，分析、论述财金风险管理各相关议题，以协助读者总览、掌握国际最新财金风险管理之基本概念，并提供最新使用之资讯，引导有志从事研究者得以进入此一新兴热门领域之殿堂，一窥堂奥。

本书尽情展现财金风险管理之科学与艺术的内涵，不仅适合作高等学校相关专业的教材，也是对金融领域有兴趣的读者学习借鉴的参考书。

<<财金风险管理>>

作者简介

刘威汉，现职：台湾国防大学国防管理学院推广教育中心研究教官，台湾东吴大学经济系兼任助理教授。

学历：美国普渡大学管理学博士，美国芝加哥大学经济学硕士，台湾国防大学国防管理学院咨询管理学士。

专长领域：财金风险管理、财力管理、财力计量经济学，数量方

## &lt;&lt;财金风险管理&gt;&gt;

## 书籍目录

第1章 简介 参考文献第2章 风险管理之简介 2.1 关于风险 2.2 风险管理 2.3 模型风险 问题与讨论  
参考文献第3章 相关数量工具之简介 3.1 时间序列分析 3.2 copula函数 3.3 极值理论 3.4 概率论 3.5  
线性回归分析、一般动差法与有效动差法 3.6 极大熵原则 3.7 模拟方法 3.8 类神经网络 3.9 资料探勘  
3.10 随机微分方程式 3.11 线性规划 3.12 动态规划 问题与讨论 参考文献第4章 风险值 4.1 关于风险  
值 4.2 其他风险测量值 4.3 测量方法 4.4 测试方法 4.5 投资组合风险值 4.6 风险预算 问题与讨论 参  
考文献第5章 信用风险 5.1 信用评分与评比 5.2 信用评等系统 5.3 信用风险模型 5.4 新版巴塞尔协  
议 5.5 信用衍生性金融商品 问题与讨论 参考文献第6章 利率风险 6.1 定义与应用范围 6.2 利率模式  
6.3 利率期限结构模型 6.4 利率风险 6.5 利率风险管理 问题与讨论 参考文献第7章 衍生性金融商品  
风险 7.1 关于衍生性金融商品 7.2 其他创新衍生性金融商品 7.3 关于衍生性金融商品风险 7.4 测量衍  
生性金融商品风险 7.5 衍生性金融商品之操作风险 7.6 衍生性金融商品之会计处理原则 7.7 运用策略  
问题与讨论 参考文献第8章 资产与负债之管理 8.1 关于资产与负债之管理 8.2 资产证券化 8.3 风险  
移转与风险证券化 8.4 避险基金 8.5 量化分析工具 8.6 避险工具 8.7 CAMEL模型 问题与讨论 参考文  
献第9章 营运风险 9.1 关于营运风险 9.2 营运风险模型 9.3 营运风险指标 9.4 资本配置 9.5 营运风  
险数据库 9.6 全企业风险管理系统 问题与讨论 参考文献第10章 风险管理之未来 10.1 风险管理的再  
省思 10.2 风险管理之未来发展 10.3 新版巴塞尔协议之影响 10.4 其他新兴风险项目与测量方法 10.5  
金控公司 10.6 结论与建议 问题与讨论 参考文献附录 财金风险管理方面之相关网际网络英文资源词  
汇表

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>