

<<高级金融风险管理>>

图书基本信息

书名：<<高级金融风险管理>>

13位ISBN编号：9787300072739

10位ISBN编号：7300072739

出版时间：2006-10

出版时间：人民大学

作者：唐唐纳德·R·范·戴维特

页数：532

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>

## <<高级金融风险管理>>

### 内容概要

信用风险、市场风险、资产与负债管理和绩效评估是金融机械管理中最重要的一部分，原来一直都被认为是各自独立的学科，但最新金融理论和计算机科学的发展，让我们能够通过定量方法综合、有效地分析这些风险，以提高管理效率。

著名风险专家唐纳德·R·范·戴维特、今井贤志，以及后来加入的马克·梅斯勒，在《高级金融风险管理》中扩展了他们在《信用风险模型与巴塞尔协议》一书中的概念，并且更新了他们于1996年出版的《金融风险分析》中所提出的相关内容。

作者给出了风险管理的度量方法、目标，以及广泛给出了一种更好的绩效评估方法，它在度量风险调整后的股东价值方面明显优于传统的资本配置技术。

更为重要的是，《高级金融风险管理》还用逐步推导的工具和技术对综合风险管理战略做了补充。

《高级金融风险管理》可作为全国大专院校财务与金融学专业教师、研究生和博士生的必读教材和教学参考书；商业银行业可将其选为对管理人员进行高级金融风险管理相关知识的培训教材；金融学博士生和全球金融体系的研究专家可将它用作高质量的参阅文献。

《高级金融风险管理》还适合其他专业研究生、金融作业人员 and 一切对全球范围的金融风险管理感兴趣的社会人士阅读和参考。

## &lt;&lt;高级金融风险管理&gt;&gt;

## 书籍目录

第一篇 风险管理：定义与目的第1章 综合风险管理：市场风险、信用风险、流动性风险及资产负债管理第2章 风险、收益与绩效第3章 资本监管、风险管理与绩效第4章 利率风险：引言与概述第5章 期限不匹配的效率风险与套期保值第6章 传统利率风险分析：差异分析与模拟模型第7章 固定收益数学：基本工具第8章 收益曲线平滑第二篇 利率分析第9章 外期与凸性第10章 久期作为期限结构模型第11章 Vasicek与扩展Vasicek模型第12章 其他可选的期限结构模型第13章 期限结构模型的参数估计第三篇 信用风险模型第14章 信用风险介绍：在贷款定价与绩效评估中使用市场信号第15章 信用风险的传统方法：评级与转移矩阵第16章 结构风险模型：默顿方法介绍第17章 简化型信用模型第18章 信用价差的拟合与建模第四篇 利率与信用模型检验第19章 使用历史数据检验信用模型第20章 使用市场数据检验信用模式第21章 使用信用风险方法检验利率模式第五篇 风险管理应用：工具论述第22章 信用风险债券估值第23章 信用衍生工具与债务抵押债券第24章 基本债券的欧式期权第25章 远期与期货合约第26章 基于远期与期货合约的欧式期权第27章 利率上限和下限第28章 利率互换与互换期权第29章 奇异互换与期权的结构第30章 美式固定收益期权第31章 固定收益期权的非理性执行第32章 抵押支持证券与资产支持证券第33章 无限期存款第34章 外汇市场：期限结构模型方法第35章 估值模式中抵押品的影响第36章 循环信贷及其他工具的定价与估值第37章 基于违约调整的普通股与可转换债券建模第38章 保险单与养老金估值第39章 投资组合与公司层面上的风险管理目标第40章 流动性风险的分析与管理第41章 绩效评价：加a与转移定价第42章 管理机构违约风险及“安全性和稳健性”第43章 住处技术的考虑第44章 股东价值的创造与毁灭参考文献

<<高级金融风险管理>>

编辑推荐

同名英文原版书火热销售中：Advanced Financial Risk Management

<<高级金融风险管理>>

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>