

<<风险管理(英文影印版)>>

图书基本信息

<<风险管理(英文影印版)>>

内容概要

全球竞争的爆炸性增长，管制的日益增加，不断变化着创新性产品组合、复杂的衍生品和资产的证券化，已经将风险管理推向当今金融活动的前台。

那些努力理解这一环境的公司和银行的管理者们经常发现，他们在浪费宝贵的时间去搜寻相关的细节，但是无知的曲解或被误导的对冲策略，实际上却会创造风险。

本书作者整合了风险管理的全部领域，从政策到方法，以及数据和技术基础构架。

《风险管理》一书涵盖了投资与对冲策略，包括创新性的衍生产品，信用风险和证券化技术——可以说，一册在手，无所不包，便于查考。

本书的三位作者是经验丰富的金融专家，他们在银行、公司和学术界从事风险管理应用的全方位的经历无可匹敌。

他们在本书中引导读者洞悉风险管理的重要问题，侧重给出具体和有效的技巧和分析。

本书会帮助读者迅速并且般彻地理解当今复杂的金融风险管理的挑战，具体地说，本书提供的专家分析和经过证明的建议包括： 风险管理整合：如何理解和开发必要的工具衡量和管理企业的全部风险； 管制环境：介绍G-30的政策建议，国际清算银行的规定，以及如何确定是否具备条件，以内部模型替代巴塞尔委员会提出的标准方法； 资本属性：如何将经济资本作为风险的函数加以配置； 实践中的衡量问题：运用历史的、隐含的和随机的模型度量易变性，以及对度量相互关系和把握收益率曲线提供有用的综述； 未来的考虑；对国际清算银行（BIS）2000规则的潜在影响进行了评论，深入分析了风险管理实践未来的演进。

银行业和公司领域的风险管理问题还从来没有像今天这样复杂，并且马虎不得，在我们进入21世纪的未知领域之际，本书无论是用八月关机构进行金融风险管理的的基本方法指南，还是作为侧重银行风险管理课程的教科书，或者仅仅作为涵盖该领域每一重要方面的尚无先例的参考书。

都会给读者带来对于风险管理这一注定日益重要领域的最具时效性的分析。

<<风险管理(英文影印版)>>

作者简介

米歇尔·克劳伊 (Michel Crouhy) 博士, 加拿大帝国商业银行全球分析和风险管理部高级副总裁, 主管市场风险和信用风险分析。
在学术刊物上著述甚丰, 现在是Journal of Derivatives和Journal of banking and Finance的主编助理, 还在Journal of Risk编辑部任职。

丹·加

书籍目录

Foreword by Robert C.Merton Introduction by John Hunkin Preface Chapter 1 1.Introduction 2.Historical Evolution 3.The Regulatory Environment 4.The Academic Background and Technological Changes 5.Accounting Systems versus Risk Management Systems 6.Lessons from Recent Financial Disasters 7.Typology of Risk Exposures 8.Extending Risk Management Systems to Nonfinancial Corporations Notes Chapter 2 The New Regulatory and Corporate Environment 1.Introduction 2.The group of 30 policy Recommendations 3.The 1988 BIS Accord :The Accord 4.The 1996 Amendment or Bis 98 5.The BIS 2000 Accord Notes Chapter 3 Structuring and Managing the Risk Management Function in a Bank 1.Introduction 2.Organizing the Risk Management Function:Three Pillar Framework 3.Data and Technological Infrastructure 4.Risk Authorities and Risk Control 5.Establishing Risk Limits for Gap and Liquidity Management 6.Conclusion:Steps to Success Notes Chapter 4 The new bis Capital Requirements for Financial Risks Chapter 5 Measuring Market Risk:The VaR Approach Chapter 6 Measuring Market Risk:Extensions of the VaR Approach and Testing the Models Chapter 7 Credit Rating Systems Chapter 8 Credit Migration Approach to Measuring Credit Risk Chapter 9 The Contingent Claim Approach to Measuring Credit Risk Chapter 10 Other Approaches:The Actuarial and Reduced form approaches to Measuring Credit Risk Chapter 11 Comparison of Industry Sponsored Credit Models and Associated Back Testing Issues Chapter 12 Hedging Credit Risk Chapter 13 Managing Operational Risk Chapter 14 Capital Allocation and Performance Measurement Chapter 15 Model Risk Chapter 16 Risk Management in Nonbank Corporations Chapter 17 Risk Management in the Future References Index

<<风险管理(英文影印版)>>

媒体关注与评论

本书是为银行家和金融经理进行有效的风险管理而提供的一本无所不包的行动指南。

《风险管理》是第一本以整书篇幅处理风险管理概念的著作，其侧重点在金融机构……该书详尽涵盖的信用风险的分析尤其及时和易于操作。

本书提供了对于信用风险、流动性风险和操作风险的透彻分析，包括可以用于度量和和管理这些风险的各种模型和方法论。

本书作者们资质卓越，将学者高度复杂的最高水平研究背景与大型金融机构中日常的丰富风险管理经验融会贯通。

<<风险管理(英文影印版)>>

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>