

<<融资租赁风险管理>>

图书基本信息

书名：<<融资租赁风险管理>>

13位ISBN编号：9787504939289

10位ISBN编号：7504939285

出版时间：2006-3

出版时间：中国金融出版社

作者：程东跃

页数：291

字数：262000

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>

## <<融资租赁风险管理>>

### 内容概要

本书在对融资租赁风险进行理论界定的基础上，运用CAMELS方法对我国融资租赁业的风险进行了客观评价，对融资租赁中的信用风险、利率风险、汇率风险，操作风险的计量与管理技术做了专门的分析，并从风险的防范与控制对策（包括风险管理中的VaR方法、风险预警系统的设计与应用），风险的分散与转移对策（包括租赁资产的分散化策略、资产证券化策略、租赁产品创新策略）两个层面提出风险防范的对策建议。

<<融资租赁风险管理>>

作者简介

程东跃，男，1959年8月生，浙江杭州人，高级经济师。  
先后在中南财经大学、浙江大学获得经济学硕士和管理学博士学位。  
在《中南财经大学学报》、《经济学动态》、《金融时报》、《管理世界》、《浙江大学学报》等报刊先后发表论文十余篇，曾主编《金融租赁与企业融资》，参与编

## &lt;&lt;融资租赁风险管理&gt;&gt;

## 书籍目录

1 导论 1.1 融资租赁风险界定 1.1.1 融资租赁风险的复杂性 1.1.2 融资租赁风险的分类及其特征 1.1.3 对融资租赁风险的一个理论解释 1.2 加强融资租赁风险管理的紧迫性 1.2.1 我国融资租赁业的发展状况 1.2.2 我国融资租赁业加强风险管理的紧迫性 1.3 国内外关于融资租赁风险管理研究的概况 1.3.1 国外研究概况 1.3.2 国内研究概况 1.4 本书研究的内容框架和方法2 运用CAMELS方法对我国融资租赁业风险进行评价 2.1 CAMELS方法的简要介绍 2.2 我国融资租赁风险的综合衡量方法的探析 2.2.1 资本充足性 2.2.2 资产质量 2.2.3 管理状况 2.2.4 盈利能力 2.2.5 流动性 2.2.6 市场敏感性 2.3 我国融资租赁业风险的实证分析 2.3.1 运用CAMELS方法对我国融资租赁风险的单项分析 2.3.2 运用CAMELS方法对我国融资租赁风险的行业分析3 融资租赁信用风险计量方法与实证 3.1 融资租赁信用风险管理的常规方法探讨 3.2 信用风险计量的模型 3.2.1 单变量模型和多变量模型 3.2.2 以资本市场理论和信息科学为支撑的信用风险模型 3.2.3 对上述模型的比较与评价 3.3 利用现代信用风险模型对我国融资租赁风险的实证研究 3.3.1 Logistic模型用于信用风险分析的原理 3.3.2 利用logistic模型对我国融资租赁信用风险评价的实证研究4 融资租赁利率风险计量方法的应用 4.1 融资租赁公司利率风险的特性 4.2 传统的利率风险管理方法在融资租赁公司中的应用 4.2.1 零利率敏感性缺口管理 4.2.2 持续期缺口管理 4.3 利用衍生金融产品来管理利率风险 4.3.1 远期利率协议 4.3.2 利率期货 4.3.3 利率互换 4.3.4 利率期权5 融资租赁汇率风险的计量与管理 5.1 国际融资租赁及其在我国的实践 5.2 融资租赁汇率风险及其计量 5.2.1 融资租赁汇率风险的种类 5.2.2 融资租赁汇率风险的计量 5.3 融资租赁汇率风险的管理 5.3.1 汇率风险管理的策略 5.3.2 汇率风险管理的工具6 融资租赁操作风险的计量与管理 6.1 操作风险及其分类 6.2 操作风险的计量方法 6.2.1 基本指标法 6.2.2 标准法 6.2.3 高级计量法 6.3 我国融资租赁公司操作风险的内部管理与外部监管 6.3.1 操作风险的内部管理措施 6.3.2 操作风险的外部监管建议7 融资租赁公司风险管理中VaR方法的应用 7.1 从资产负债管理到VaR方法 7.2 VaR方法在融资租赁风险管理中的应用 7.2.1 VaR方法在融资租赁信用风险管理中的应用 7.2.2 VaR方法在融资租赁市场风险管理中的应用 7.3 融资租赁风险管理中引入VaR方法的实证分析8 融资租赁风险预警系统的设计与应用 8.1 融资租赁风险预警系统指标应具有的特点 8.2 租赁公司风险预警指标体系的设计 8.3 承租企业的风险预警指标体系的设计 8.4 融资租赁风险预警系统模型分析9 融资租赁风险管理的分散化策略 9.1 组合投资——融资租赁风险分散化的理论基础 9.2 组合投资管理——融资租赁资产风险分散化的应用方法10 融资租赁资产证券化策略 10.1 融资租赁资产证券化的现实意义和有利条件 10.1.1 租赁资产证券化的现实意义 10.1.2 我国融资租赁资产证券化的有利条件 10.2 融资租赁资产证券化的基本内容 10.2.1 融资租赁资产证券化的基本结构 10.2.2 我国融资租赁资产证券化的模式选择 10.2.3 融资租赁资产证券化的定价方法 10.3 我国实施租赁资产证券化的对策11 融资租赁产品创新与风险管理 11.1 杠杆租赁 11.2 委托租赁与委托租赁基金 11.2.1 委托租赁 11.2.2 委托租赁基金 11.3 结构化共享式租赁 11.4 租赁信托计划 11.5 转租赁参考文献附录 附录一：全球融资租赁业发展的特点和趋势分析 附录二：全球租赁业发展数据表后记

<<融资租赁风险管理>>

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>