

<<金融风险测量和全面风险管理>>

图书基本信息

书名：<<金融风险测量和全面风险管理>>

13位ISBN编号：9787547806715

10位ISBN编号：7547806716

出版时间：2011-6

出版时间：上海科学技术出版社

作者：(加)陈公越，(加)于盟，许威 著

页数：231

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>

## <<金融风险测量和全面风险管理>>

### 内容概要

陈公越、于盟、许威所著的《金融风险测量和全面风险管理——理论应用和监管》以巴塞尔 规定的金融风险为主线，全面系统性地介绍了影响金融业的稳定和持续发展的三大风险：市场风险、信用风险和操作风险及其相对应的量化计算方法，对目前金融市场经过动荡后在恢复过程中怎样避免重蹈覆辙非常重要。

该书包括了巴塞尔 协议的最新条款，对由风险资产所需的资本金的计算做了详细的阐述。

因此对那些想了解国外金融业风险管理运作的风险部经理、银行和证券公司的领导人员都非常有用。另外该书系统性非常好，由浅入深，只要有点金融和数学知识的人都能够阅读，是大学生和研究生的好教材。

<<金融风险测量和全面风险管理>>

书籍目录

- 第一章银行的功能和全面风险管理
  - 1.1 银行的业务和风险特征
  - 1.2 商业银行信贷管理流程
  - 1.3 银行的风险管理
  - 1.4 风险管理的组织结构
  - 1.5 全面风险管理的概念
    - 1.5.1 理想企业风险管理框架的特征
    - 1.5.2 有效风险管理框架的功能
    - 1.5.3 有效风险管理的监管原理
  - 1.6 风险测量和风险管理应用
  - 1.7 金融风险监管历史背景
- 第二章 风险类型与风险管理核心工作
- 第三章 风险测量的基本理论要素
- 第四章 信用风险的测量方法
- 第五章 信用风险组合和经济资本模型
- 第六章 操作风险管理的基本框架
- 第七章 操作风险数据、量化和经济资本
- 第八章 市场风险计量
- 第九章 其他风险、资产负债和流动性风险管理
- 第十章 监管资本、经济资本及其应用
- 第十一章 风险资本的内部管理和外部监管
- 第十二章 风险测量和管理系统的设计和应用
- 附录
- 参考文献
- 索引

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>