

<<金融风险管理>>

图书基本信息

书名：<<金融风险管理>>

13位ISBN编号：9787562920601

10位ISBN编号：7562920605

出版时间：2004-12

出版时间：武汉理工大学出版社

作者：王仁祥

页数：270

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>

## <<金融风险管理>>

### 内容概要

金融学最核心的课题是对风险的管理。

金融就是要形成这样一种安排，即通过利用多数人来分散发生在个别人身上的风险，减少个别人所承受的损失；鼓励创造者和发明者抛开风险顾虑实现自己的梦想；鼓励人们为了更好的收益而去冒更大的风险。

本书以风险管理的理念为指导，立足于我国金融部门的发展实际，沿着金融风险管理的技术路线和制度构架分别展开论述。

在金融风险管理的技术层面上，探讨了金融风险的识别、度量与预警等三个方面，构成了金融风险管理的基础。

在金融风险管理的操作层面上，首先分析了信用风险、利率风险、流动性风险与汇率风险等四种主要金融风险的管理；其次对银行、证券、保险、信托、租赁与房地产等六种主要金融业务的风险管理进行了全面论述。

因此，对金融风险管理论述的系统性和全面性构成了本书的两大特色。

## 作者简介

王仁祥，男，1961年出生，教授、博导，武汉理工大学经济学院院长，湖北省经济学学会副会长，湖北省企业管理协会理事，湖北省青年科协常务理事，潜江制药（上市公司）独立董事。

“湖北省跨世纪学术带头人”，湖北省科技进步三等奖一项，机械工业部科研成果二等奖一项，中国人民银行武汉分行重大科研成果二等奖一项。

在《经济科学》、《经济学动态》、《经济评论》、《经济问题》、《财经研究》、《金融论坛》、《世界经济文汇》等学术刊物上发表金融方面的学术论文70余篇，公开出版《金融风险管理》、《国际金融学》、《证券投资学》等教材和著作11部，主持完成金融创新效应评价与风险管理机制研究，湖北省中小企业融资结构与融资创新，湖北省科委重点项目，区域金融创新系统与武汉金融竞争研究，武汉市社科基金，武汉市发改委课题等纵向和横向科研项目20余项。

## &lt;&lt;金融风险管理&gt;&gt;

## 书籍目录

- 1 金融风险概述 1.1 金融风险的内涵与特征 1.1.1 金融风险的内涵 1.1.2 金融风险的特征 1.2 金融风险的分类 1.3 金融风险管理的程序 1.4 金融风险管理的策略
- 2 金融风险识别 2.1 金融风险识别概述 2.1.1 金融风险识别的内容 2.1.2 金融风险识别的意义 2.1.3 金融风险识别的原则 2.2 金融风险资料的整理 2.2.1 金融风险资料 2.2.2 金融风险资料的收集与整理 2.2.3 金融风险资料统计图 2.3 金融风险识别的定性分析 2.3.1 金融业务特征与金融风险识别 2.3.2 金融业务管理与金融风险识别 2.4 金融风险识别的定量方法 2.4.1 保险调查法与集思广益法 2.4.2 德尔菲法与幕景分析法 2.4.3 财务报表法与事件树分析法
- 3 金融风险度量 3.1 金融风险度量概述 3.1.1 金融风险度量的因素 3.1.2 金融风险统计测度的方法 3.1.3 金融风险统计测度的原则 3.1.4 金融风险统计测度指标的选择 3.1.5 金融风险统计测度指标体系 3.2 金融风险度量的定性与定量分析 3.2.1 金融风险度量的定性分析方法 3.2.2 金融风险度量的定量分析方法 3.2.3 效用理论与风险度量 3.3 金融风险监测指标与度量模型 3.3.1 非系统性金融风险监测指标体系 3.3.2 非系统性金融风险的度量模型 3.3.3 系统性金融风险监测指标体系 3.3.4 系统性金融风险的度量模型 3.3.5 金融风险的综合评估
- 4 金融风险预警 4.1 金融风险监测预警系统的内涵 4.2 金融风险监测预警系统设计 4.2.1 金融风险监测预警组织系统构造 4.2.2 非系统性金融风险监测与预警系统的设计 4.2.3 系统性金融风险的因素分析及监测指标 4.2.4 金融风险度量模型 4.2.5 预警系统警示种类及警示传导设置 4.3 银行的经营管理风险预警模型 4.3.1 预警目的 4.3.2 GM(1, 1)模型 4.3.3 银行经营状况的实证分析
- 5 金融风险管理的方法 5.1 金融风险管理的定性方法 5.1.1 避免风险 5.1.2 自留风险 5.2 金融风险管理的定量方法 5.2.1 损失控制 5.2.2 风险转移 5.2.3 内部风险抑制 5.3 金融风险的工程化管理 5.3.1 远期合约 5.3.2 金融期货 5.3.3 金融期权 5.3.4 金融互换 5.3.5 其他金融衍生工具 5.4 案例讨论
- 6 信用风险管理 6.1 信用风险概述 6.1.1 信用风险的定义 6.1.2 信用风险的因素分析 6.2 信用风险的评价 6.2.1 信用风险评价的目的 6.2.2 贷款的风险量化评价 6.3 信用风险的防范 6.3.1 积极的贷款定价策略 6.3.2 科学的贷款投放决策 6.3.3 资产分散化策略 6.3.4 建立风险资本比约束机制
- 7 利率风险管理 8 流动性风险管理 9 汇率风险管理 10 金融业务的风险管理(一) 11 金融业务的风险管理(二) 11.2 金融租赁风险管理 11.3 房地产金融投资风险管理 参考文献 后记

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>