

<<金融风险计量与管理>>

图书基本信息

书名：<<金融风险计量与管理>>

13位ISBN编号：9787564202231

10位ISBN编号：7564202238

出版时间：2008-7

出版时间：上海财经大学出版社

作者：王明涛

页数：252

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>

## <<金融风险计量与管理>>

### 前言

1997年席卷东南亚的金融危机、2007年至今的美国次级债危机，不仅严重地摧残了金融危机爆发国家的经济，也极大地影响了世界经济的发展，引起了世界各国政府及有关学者的高度重视和广泛关注；另外，20世纪90年代以来，国际金融市场发生的一系列风波，如英国的巴林银行倒闭案、美国的加州橙县破产案、日本昭和外汇损失案、法国的兴业银行案等，都引发了人们对金融风险计量理论及管理方法的反思和重视。

随着经济全球化进程的加快和我国金融市场的发展与对外开放，我国投资者在享有更丰富金融产品的同时，所面临的各类金融风险也越来越复杂，如何计量和管理这些风险，是实务界和理论界所关心的重要问题。

目前国内有些高校已开始向研究生或本科生讲授有关金融风险计量与管理的课程，以应对日益复杂的金融市场。

目前，国内有关金融风险管理方面的书籍较多，但这些书籍大多是将金融风险管理与金融衍生品混在一起，这不但不利于对金融风险本身的认识，也不利于对风险分类管理。

另外，金融风险管理的基础与前提是风险计量，而国内同时将金融风险计量与管理放在一起成书的同类型书籍还不多。

本书在总结传统金融风险计量与管理的基础上，不但将金融风险计量与金融风险管理的内容有机结合在一起，同时加入“信用风险、流动性风险、操作风险”等金融风险计量管理的最新内容，以反映最新的研究成果。

本书分为上篇和下篇两部分，上篇为基础篇，下篇为应用篇。

上篇主要介绍金融风险计量与管理的基本理论与基本方法，包括第一章到第五章的内容。

第一章介绍金融风险计量与管理的基本概念；第二章介绍金融风险计量的基本理论与方法；第三章介绍金融风险管理的基本理论与基本方法；第四章介绍金融风险管理的主要工具——金融衍生品及其定价；第五章介绍金融风险管理的基本方法——金融衍生品的应用。

## <<金融风险计量与管理>>

### 内容概要

目前，国内有关金融风险管理方面的书籍较多，但这些书籍大多是将金融风险管理与金融衍生品混在一起，这不但不利于对金融风险本身的认识，也不利于对风险分类管理。

另外，金融风险管理的基础与前提是风险计量，而国内同时将金融风险计量与管理放在一起成书的同类型书籍还不多。

本书在总结传统金融风险计量与管理的基础上，不但将金融风险计量与金融风险管理的内容有机结合在一起，同时加入“信用风险、流动性风险、操作风险”等金融风险计量管理的最新内容，以反映最新的研究成果。

## &lt;&lt;金融风险计量与管理&gt;&gt;

## 书籍目录

前言上篇 基础篇第一章 金融风险计量与管理概论第一节 金融风险计量与管理概述 一、金融风险的基本概念二、金融风险的分类三、金融风险计量与管理的意义四、金融风险管理的目标、方式与步骤第二节 金融风险计量与管理的基本理论与方法一、金融风险计量的一般理论与基本方法二、金融风险管理的的基本理论三、金融风险管理的的基本方法第三节 主要金融风险计量与管理方法一、市场风险的计量与管理二、利率风险的计量与管理三、信用风险的计量与管理四、流动性风险的计量与管理五、操作风险的计量与管理复习思考题第二章 金融风险计量的基本理论与方法第一节 金融风险计量的基本理论 一、基于效用函数的风险金计量模型二、Fishburn的一般计量模型三、风险计量的一般标准第二节 金融风险计量的一般方法一、方差类计量方法二、信息熵方法三、非线性分形几何方法四、下偏矩计量方法五、VaR方法复习思考题第三章 金融风险管理的的基本理论与方法第一节 金融风险管理的的基本理论一、投资组合理论二、无套利原理三、风险管理制度化理论第二节 金融风险管理的的基本方法一、非系统风险管理方法二、系统风险管理方法复习思考题第四章 金融风险管理的的主要工具——金融衍生品与定价第一节 金融远期与金融期货的概念与定价一、金融远期合约的概念与分类二、金融期货的概念与分类三、金融远期与期货的定价第二节 金融互换的概念与定价一、金融互换的基本概念二、金融互换的定价第三节 金融期权的概念与定价一、金融期权的基本概念二、金融期权的定价第四节 信用衍生品的定价一、公司股票和债券的定价——莫顿方法二、可赎回债券的定价三、可转换(不可赎回)债券的定价复习思考题第五章 金融风险管理的的基本方法——金融衍生品的应用第一节 金融远期在金融风险管理中的应用一、基本思想二、金融远期的应用实例三、金融远期协议的应用第二节 金融期货在金融风险管理中的应用一、套期保值的基本原理与基本步骤二、套期保值比率的确定三、期货套期保值实例四、期货套利第三节 金融互换在金融风险管理中的应用一、基本思想二、金融互换的应用实例第四节 金融期权在金融风险管理中的应用一、基本思想二、期权价格对各种影响因素变化的敏感性指标三、期权套期保值复习思考题下篇 应用篇第六章 市场风险的计量与管理第一节 市场风险概述一、市场风险的基本含义二、市场风险的特点第二节 市场风险计量的一般方法一、波动性方法二、损失波动性方法三、市场因子灵敏度法四、信息论方法五、损失量方法六、压力试验方法与极值分析方法第三节 VaR的基本概念一、VaR的基本含义二、注意的问题第四节 独立同分布正态收益率下的VaR计算一、单一证券VaR的计算二、证券组合VaR的计算三、边际VaR的计算四、连续复利正态分布收益率情况下VaR的计算五、含有非线性衍生品组合的VaR计算第五节 非独立同分布正态收益率下的VaR计算一、应用历史收益率密度计算VaR二、可变量方差正态分布收益率情况下VaR的计算三、收益率服从混合正态分布情况下VaR的计算第六节 市场风险的管理方法一、制度化风险管理方法二、分散化投资方法三、价值分析法四、应用金融衍生品管理风险的方法复习思考题第七章 利率风险的计量与管理第一节 利率风险的概念一、利率的定义与计量二、利率风险的含义与影响因素第二节 利率风险的计量一、利率风险计量的一般方法二、久期计量法三、基点价值计量法四、利率风险的久期凸度计量方法五、利率敏感性缺口模型第三节 利率风险的管理一、基于利率衍生工具的风险管理二、利用久期管理利率风险三、缺口管理复习思考题第八章 信用风险计量与管理第一节 信用风险的概念一、信用风险的含义二、信用风险的影响因素三、信用风险的主要特点第二节 信用风险的计量一、专家评级系统二、信用等级计量法三、财务指标模型四、信用差额计量法五、违约概率的计算六、期望损失方法七、KMV模型和“违约距离”方法八、VaR模型第三节 信用风险的管理一、分散化投资方法二、信用风险分析法三、应用信用衍生品管理信用风险复习思考题第九章 流动性风险的计量与管理第一节 流动性的概念一、流动性的基本含义二、市场流动性的影响因素第二节 流动性的计量一、价格法二、交易量法三、价量结合法四、时间法五、不同流动性衡量法比较标准第三节 流动性风险的计量一、流动性风险的内涵与特点二、流动性风险的计量第四节 流动性风险的管理一、积极发展多层次的金融市场,提高资产的流动性二、在金融市场中引入竞争机制,提高资产的流动性三、进行金融创新,提高资产的流动性四、利用资产交易特征,进行流动性风险管理五、利用组合方法分散流动性风险六、开发流动性衍生品,防范流动性风险七、根据收益率的要求,保留适当的流动性风险复习思考题第十章 操作风险的计量与管理第一节 操作风险的概念一、操作风险的定义二、操作风险的分类三、操作风险的特点四、操作风险与

<<金融风险计量与管理>>

其他金融风险的关系第二节 操作风险的计量一、操作风险计量方法概述二、操作风险的几种主要计量方法第三节 操作风险的管理一、操作风险管理的基本方法二、操作风险管理的基本步骤复习思考题参考文献

## &lt;&lt;金融风险计量与管理&gt;&gt;

## 章节摘录

第一章 金融风险计量与管理概论 第一节 金融风险计量与管理概述 一、金融风险的基本概念 (一) 风险的基本含义 风险是一个复杂的概念, 有人认为风险是事情未来结果的不确定性, 是收益的来源; 有人认为风险是事情出错的几率; 也有人认为风险是事情出错时造成损失的大小。

一般认为风险是与损失的不确定性联系在一起的概念, 但对于这一基本概念, 经济学、决策学、统计学、金融保险学中尚无统一的定义, 许多学者从不同方面对此进行了探讨。

总结起来, 有以下几种观点: 第一种观点(古典决策理论的观点)认为, 风险是事件未来可能结果的不确定性, 它可能使事情变好, 也可能使事情变坏。

它可以用可能结果概率分布的方差描述。

由于方差计算的方便性, 风险的这种定义在实际中得到了广泛的应用, 但由于此观点与行为理论及效用理论不相符, 因而受到了越来越多学者的批评。

Mao (1970) 发现经理人员是根据目标不足而不是根据方差来描述风险; March and Shapira (1987) 指出, 他们所调查的80%的经理人员在考虑风险时, 仅考虑负面结果, 而不把正面结果的不确定性看成风险; Hoskisson, Hitt&Hill (1991) 认为, 管理者与投资者是“损失厌恶而不是方差或易变性厌恶”

。因此, 用易变性(不确定性)描述风险, 具有其固有的缺陷。

第二种观点认为风险是事情出错的可能性或损失可能性, 可用损失的概率表示。

## <<金融风险计量与管理>>

### 编辑推荐

目前，国内有关金融风险管理方面的书籍较多，但这些书籍大多是将金融风险管理与金融衍生品混在一起，这不但不利于对金融风险本身的认识，也不利于对风险的分类管理。另外，金融风险管理的基础与前提是风险计量，而国内同时将金融风险计量与管理放在一起成书的同类型书籍还不多。

<<金融风险计量与管理>>

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>