

<<银行信贷信用风险分析和度量>>

图书基本信息

书名：<<银行信贷信用风险分析和度量>>

13位ISBN编号：9787806817827

10位ISBN编号：7806817824

出版时间：2006-2

出版时间：上海社会科学院出版社

作者：汪其昌

页数：368

字数：290000

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>

<<银行信贷信用风险分析和度量>>

内容概要

金融机构的业务人员在做信贷、银行承兑汇票、保理、信用证、信托投资、信用风险保险等业务时，如何对交易对手的信用风险进行分析和度量？

如何避免信贷周期亲顺经济周期？

本书对此将经济金融学的基本原理化为具有实用性和操作性的具体方法，如怎样识别企业财务报表的真实性和质量、对经济增加值的计算方法、对企业集团不当关联交易手法的辨别、从不同角度对企业竞争力的判断、对产业集聚风险的分析，在开放经济条件下，如何从国际产业的关联互动、汇率变动、跨国投资、资本自由流动导致资产价格波动等方面预警信贷信用风险的传导。

本书还从单笔信贷、信贷资产组合的角度，对信贷信用风险如何进行定性分析和测量进行了探索 and 介绍。

“授人以鱼，不如授人以渔”，因此，本书对于金融机构的相关从业人员和理论研究人员具有相当的实用性和启发性。

<<银行信贷信用风险分析和度量>>

书籍目录

序 第一章：问题的提出和研究述评 第一节 风险的性质与来源 一 风险的概念 二 风险的来源 三 风险的本质和内在特性 第二节 货币的起源与信贷信用风险的产生 一 经济人的本性与货币的起源和本质 二 信贷信用风险的产生和信贷市场特点 第三节 选题的理论和实践意义 一 选题的理论意义 二 选题的实践意义 第四节 信贷信用风险分析和度量的研究述评 一 实务述评 二 理论研究述评第二章：银行信贷信用风险分析和度量的理论基础 第一节 微观经济学基础：不确定状态下的选择理论和信贷配给理论 一 风险和回报的权衡，投资者的风险偏好和效用函数 二 无差异曲线和确定性等值回报率 三 信息不对称对投资决策的影响之一：非齐性预期 四 信息不对称对投资决策的影响之一：信贷配给理论 五 对银行信贷信用风险分析和度量的意义 第二节 现代资产组合理论和风险收益最优化理论 一 基本理论前提和假设 二 理论的主要内容及其推导 三 资产组合管理理论对信贷信用风险分析和度量的意义 第三节 资本资产定价模型和资本市场均衡中的风险定价 一 资本资产定价模型（CAPM） 二 套利定价理论 三 资本资产定价模型对信贷信用风险分析和度量的意义 第四节 期权定价模型和风险管理 一 二项式期权定价模型（BOPM）的主要内容 二 布莱克-舒尔茨期权定价模型的主要内容 三 期权定价理论对于信贷信用风险分析和度量的意义第三章：财务报表与银行信贷信用风险分析.....

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>