

《现代金融风险管理——衍生金融工具的使用与风险管理技术的应用》

书籍信息

版次：1
页数：559
字数：900000
印刷时间：2007年07月01日
开本：
纸张：胶版纸
包装：平装
是否套装：否
国际标准书号ISBN：9787305051197

编辑推荐

本书共分为市场风险的测量与管理、信用风险的测量与管理、操作风险的测量与管理及风险管理定量分析四篇。本书的内容涉及对现代风险管理工具、理论成果和实践方法的介绍，具体涉及到期货、远期、期权、互换以及由其扩展出来的金融衍生工具的定价及使用、信用风险的测量和传统管理方法、信用衍生产品的介绍与使用、操作风险COSO协议、新巴塞尔协议的内容介绍等。通过对本书的学习，读者将学会如何运用这些工具和方法来更科学地、更合理地管理和控制各种金融风险。

内容简介

注册金融风险管理师（Certified Financial Risk Manager, CFRM）项目是为了配合上海市建立金融人才战略高地的战略目标，由上海市紧缺人才工程办公室推出的专业证书。该认证考试项目与全球风险管理师协会（GARP）、香港金融风险管理师协会（HKARP）合作，引进GARP美国金融风险管理师（Financial Risk Manager, FRM）考试的*知识体系，将金融风险管理*的理念与最好的方法引入到中国，并结合中国金融机构风险管理的具体实践，培养适应现代金融业需求的金融风险管理的高端人才。

本书循序渐进、深入浅出地介绍了金融风险管理中遇到的各种产品和方法。本书*的特点在于作者结合具体实例讨论了国际先进的风险控制和管理方法，即使是金融初学者，通过此书也会对金融风险管理产生极大的兴趣。

本书既是注册金融风险管理师（CFRM）和美国金融风险管理师（FRM）考试的辅导教材。亦可作为高等院校金融相关专业学习金融风险管理的教材，同时也可供风险管理从业人员作为专业操作指南。

作者简介

邬瑜骏，新加坡南洋理工大学金融学博士，特许金融分析师（CFA）持证人，美国风险管理师（FRM）持证人，2007年FRM考试全球命题人。现任职于厦门大学财务管理与会计研究院，硕士生导师。先后任教于南洋理工大学南洋商学院，复旦大学经济学院国际金融系，厦门大学财务管理和

目录

第一篇 市场风险的测量与管理篇

第1章 风险管理简介

第2章 远期市场和远期合约
第3章 期货市场和期货合约
第4章 期权市场和期权合约
第5章 互换市场和互换合约
第6章 利率和利率风险的衡量
第7章 利率衍生产品
第8章 奇异期权
第9章 Black-Scholes期权定价模型
第10章 期权定价的二叉树模型
第11章 期权价格的风险因素
第12章 基于期货和远期合约的风险管理策略
第13章 基于期权合约的风险管理策略
第14章 基于互换合约的风险管理策略
第15章 风险价值VaR
第16章 压力测试
第二篇 信用风险的测量与管理篇
第17章 信用风险管理概述
第18章 债券及贷款的信用风险衡量
第19章 交易对家的信用风险衡量
第20章 国家主权风险
第21章 信用风险的组合模型
第22章 运用信用衍生工具管理信用风险
第23章 运用资产证券化管理信用风险
第24章 贷款出售和其他信用风险管理技术
第25章 信用风险管理和战略资本配置
第三篇 操作风险的测量与管理篇
第26章 操作风险
第27章 其他风险
第28章 经济资本管理
第29章 公司范围风险管理
第四篇 风险管理定量分析篇
第30章 概率论基础
第31章 数理统计基础
第32章 随机变量和概率分布
第33章 抽样和估计
第34章 假设检验
第35章 一元线性回归
第36章 多元线性回归
第37章 估计波动率和相关系数
附录1 经典风险管理案例分析——长期资本管理公司（LTCM）的传奇
附录2 LTCM大事记
附录3 金融危机的蔓延机制（financial contagion）

附录4 术语表
参考文献

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www.tushupdf.com](http://www.tushupdf.com)