

# 《综合风险管理》

## 图书基本信息

书名：《综合风险管理》

13位ISBN编号：9787505845770

10位ISBN编号：7505845772

出版时间：2005-10

出版社：经济科学出版社

作者：[美]尼尔·A.多尔

页数：414

版权说明：本站所提供下载的PDF图书仅提供预览和简介以及在线试读，请支持正版图书。

更多资源请访问：[www.tushu111.com](http://www.tushu111.com)

# 《综合风险管理》

## 内容概要

本书结合了当今最好的保险和财务风险管理方面的策略和产品，为公司提供了具有创新意义的，用于管理从危险风险到财务风险的有效解决方案。最新的广泛研究和案例分析已经表明了公司如何运用财务管理和保险技术对公司风险进行整体化管理，包括财务风险、可保风险，运作风险和经营风险。本书介绍的综合性方法重在分析风险的所有来源，说明了如何利用当今最有效的技术来成功地管理公司所面临的风险。

# 《综合风险管理》

## 书籍目录

前言第1章 保险风险管理和财务风险管理的融合 1.1 保险和风险管理 1.2 衍生品市场的增长 1.3 学术观点的变迁 1.4 整体化风险管理 1.5 本书的计划第2章 风险和效用:经济概念和决策原则 2.1 决策原则的推导 2.2 保险和期望效用原则 2.3 个人风险管理 2.4 如何在处理一种风险时考虑其他风险 2.5 其他决策原则 2.6 结论第3章 道德风险和逆向选择 3.1 道德风险 3.2 事前道德风险 3.3 逆向选择 3.4 结论第4章 组合理论和风险管理 4.1 保险组合概述 4.2 独立非同质风险单位保险组合中风险的降低 4.3 风险单位间相关性的度量 4.4 非独立风险单位保险组合中风险的降低 4.5 具有相关的风险单位的风险降低 4.6 三个应用 4.7 (非保险)公司的分散化和总损失分布 4.8 结论第5章 资本市场理论 5.1 投资者只拥有一种证券的资本市场 5.2 分散化投资下的资本市场均衡 5.3 对资本资产定价模型的检验 5.4 关于财务管理的推论 5.5 关于风险管理的推论 5.6 结论第6章 衍生工具与期权第7章 为什么风险对公司是有成本的第8章 风险管理策略第9章 损失后投资决策和损失的度量第10章 损失后融资:融资可行性和不良投资第11章 损失后融资:流动性和债务重组第12章 或有融资第13章 或有财务杠杆策略和混合型负债第14章 套期保值与保险第15章 组织形式和风险管理:有限责任第16章 案例分析:巨灾风险证券化索引译者后记

# 《综合风险管理》

## 精彩短评

1、这本书读懂了,就在本质上理解了风险.而不是感官上.通过很理论来论述人们对风险的喜好.读起来很费劲,最好数学功底厉害一点,否者白搭.

## 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:[www.tushu111.com](http://www.tushu111.com)