

《风险管理实务》

图书基本信息

书名：《风险管理实务》

13位ISBN编号：9787504922731

10位ISBN编号：7504922730

出版时间：2000-02

出版社：中国金融出版社

作者：寇日明

页数：345

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

《风险管理实务》

内容概要

我们写本书的目的是为了提供一个如何在金融机构日常操作的基础上有效运用风险管理理论的指南。在这一点上，我们主要注重市场风险的管理，因为这是现代风险管理技术开始发展和至今技术发展得最为充分的一种风险。同时，风险管理这一领域的发展非常快，就在我们将本书付印的过程中；关于风险管理的想法和观点仍在不断进展着。当然，有关其他重要风险如信用风险和操作风险的管理，当它们达到同样的发展水平时，也会得到同样的重视。

在本书中，我们首先总体介绍一下主要的论题，再逐步进行具体阐述。同时，本书力求对专业读者和非专业读者都适用。基于这种想法，我们使本书在不影响总体信息的情况下可以进行选择性阅读。例如，我们尽量避免过多使用专业术语，但在风险管理这样复杂的论题中运用一些专业术语是难以避免的。我们相信本书的结构可以使读者跳过那些比较专业的篇章而不至于影响对本书的总体理解。

我们力求将我们两个公司所运用的风险管理的实际操作都写入书中。这么说并不意味着我们已经想到或提供了有关这个大论题下的所有方面。我们尽量要做的是起码要提供一种考虑风险的思路，并列出了我们两个公司在风险管理实践中遇到的关键性的问题。

本书共分为四篇。第一篇从现实和历史角度讲述风险管理的概况，并对市场风险加以定义。第二篇介绍了当今用以测量风险的各种方法和工具。第三篇阐述风险管理的步骤，如何使其发挥作用和如何知道结果。第四篇作为总结，进一步开阔风险分析和资本配置的视野，并试图看清未来的公司形式。

书籍目录

第一篇风险管理概述

本篇主要介绍风险管理的概念，使读者对风险管理部门的日常操作有一个感性认识。本篇研究风险管理的起源，介绍影响其发展的一些重大事件，以及它现在为什么成为金融机调的一顶重要业务。本篇明确了建立风险管理职能的管理和组织形式，以及本书所要阐明的主要论题。本篇讨论并开始着眼于目前风险管理体系中发展得最为充分的市场风险。

第一章风险管理的一天

引言

交易日

总结

第二章风险管理的开始

20世纪70年代：金融工具衍生产品的早期发展

20世纪80年代：国际金融形势的变化

1992～1994年：对衍生工具的关注日益增长

1995年：新加坡的一天

焦点下的风险管理

总结

第三章公司整体风险管理的结构

公司整体风险管理的起源

公司整体风险管理的范围

公司整体风险管理的结构

公司整体风险管理的程序

总结

第四章市场风险的分类

引言

金融工具的分类

按所有者权益和资产的流量分类

主要市场风险的分类

其他市场风险

总结

第二篇衡量市场风险的工具

本篇将探讨怎样组合一个有效的工具箱来衡量一家公司的市场风险。我们将解释并讨论极限测试、风险价值和情景分析这三种工具在这一问题上的相对优劣性。这些工具相互之间起着互补的作用，而不同的公司会依据其各自不同的组织结构和业务背景偏重于不同的方法。另外，我们还将探讨在衡量某些特定风险的所涉及的、未被充分研究的原则。

第五章风险衡量的挑战

引言

风险的累积和规范化

风险聚集

极限测试

风险价值

情景分析

总结

第六章极限测试

引言

对测试对象的定义

监管性要求

关于极限测试的一些问题

极限测试与情景分析

极限测试的步骤

需要注意的几个问题

极限测试的可信度

总结

附录：极限测试实例

第七章 风险价值

引言

风险价值的主旨

理解风险价值

风险价值的五个步骤

风险价值的平衡关系

总结

第八章 情景分析

引言

定义情景分析

情景准备和相关问题

情景的其他应用

总结

第九章 特定风险

为什么特定风险如此重要

特定风险的一个简单模型

总结

技术附录

第三篇 风险管理实务

这部分将阐述市场风险管理职能在实际应用和维持中遇到的问题，以及相关的支持程序、技术和文化环境，并大致描述机构内的相互联系和外部环源构成及影响。本篇还讨论人员如何配置，风险管理职能如何运行，相关信息类型和结构如何设置，并且如何保证数据的准确性及方法的有效性，特别强调了在机构内创造一个风险管理的文化氛围的重要性。另外，也讨论了在银行和证券机构以外的机构中风险管理运行的一些问题。

第十章 风险管理职能

引言

高级管理层的工作

营造一个浓厚的风险文化氛围

风险管理的责任

相关的结构和技能要求

风险管理部门和其他部门的关系

总的原则和指导思想

风险额度的设定

总结

第十一章 风险分析和报告

引言

风险分析和报告的基础

有效风险管理的工具

信息披露

输入到前台的信息

高级管理层的信息要求

总结

第十二章 事后检测

- 引言
- 风险价值与实际的损益
- 理论的损益值与实际的损益值相比较
- 总结
- 附录：事后检测 划分测试结果区
- 第十三章存货定价和价格验证
- 引言
- 存货定价
- 价格验证
- 总结
- 附录：一个衍生期权的价格验证
- 第十四章衍生产品模型
- 引言
- 模型验证和有关的控制
- 模型风险
- 总结
- 第十五章风险信息流程
- 引言
- 风险信息数据的要求
- 风险数据的来源
- 风险数据储存和处理
- 风险分析和发布
- 总结
- 第十六章其他机构的风险管理
- 引言
- 风险管理的构造模块
- 一个一体化石油公司中的风险管理
- 一个养老基金的风险管理
- 中央银行的风险管理
- 总结
- 第四篇文化着的风险管理世界
- 本书的最后部分探讨风险管理理论和实践的发展是对公司运作的大环境产生了怎样的影响。它特别关注了管理结问的适应性变化，因为这种变化把重点放在风险管理实践的质晏上。它还讲到了旨在结投资者提供更有意义的风险概况信息的会计与揭示规则的蛮化、业绩衡晏以及资本配置的总体风险指标。最后，它以一种更是想象力的方式，描述了在2008年一家成功的公司将会是什么样子。
- 第十七章对金融公司的管理
- 引言
- 为什么要管理？
- 银行业的管理
- 证券业的管理
- 欧盟与资本充足率规定
- 巴塞尔 / 国际证券组织联合会计划
- 巴塞尔委员会与内部模型
- 衍生产品政策集团与美国证券交易委员会
- 提前承诺：制定资本标准的另一方法
- 风险管理与全球性公司的监控
- 总结
- 第十八章报告与揭示
- 引言

衍生产品 报告与揭示

国际会计准则：统一否？

风险揭示

其他有关方面的观点：分析家与股东

总结

第十九章管理风险资本

引言

金融公司为什么不同？

投资与资本配置的对比

资本配置

衡量经风险因素调节后的资本收益率

资本配置过程

总结

第二十章2008年的生活

引言

风险管理的未来趋势

时间：2008年

总结

《风险管理实务》

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