

《管理金融风险》

图书基本信息

书名：《管理金融风险》

13位ISBN编号：9787300043883

10位ISBN编号：7300043887

出版时间：2003-9

出版社：人民大学

作者：史密森

页数：612

译者：应惟伟

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.tushu000.com

内容概要

《管理金融风险:衍生产品、金融工程和价值最大化管理指南(第3版)》内容简介:曾经依赖技术优势和营销技巧来进行有效竞争的企业,在过去20年遇到了一大堆新挑战。汇率、利率和商品价格的波动性——在很长一段时间中曾被认为对企业长期业绩的影响无足轻重——在今天的全球经济中已成为一个核心的战略要素。由于市场需要有效、可行的方法来控制金融价格风险(实际上是把风险转移给第三方),于是出现了无数的远期、期货、互换、期权和混杂证券。在《管理金融风险——衍生产品、金融工程和价值最大化管理》中,风险管理者已经找到了他们需要的各种信息。由于这本重要和有影响力的著作,现在数以万计的金融专业人士已经理解并知道如何利用衍生产品,把这些威力巨大的工具用于降低风险和成本的项目。

与前两版相比,《管理金融风险——衍生产品、金融工程和价值最大化管理》第三版在内容上作了进一步完善。它仍涵盖了所有重要的衍生产品问题——从最基本的到最复杂的——同时把最新的信息和研究进展传递给需要它们的金融专业人士。在这个包罗万象的版本中,你可以找到创造性、有智慧、有效地使用衍生工具的答案:

日益增强的金融风险对企业的影响,包括详细的历史案例,既有成功的也有失败的。

确立风险管理理念、实施风险管理项目以及准确评估其绩效的技术。

讨论风险管理如何能提高企业价值、降低交易成本,以及降低错误投资决策的可能性。

衡量企业金融价格风险敞口的内在和外在方法。

专家专栏提供了从交易商和最终用户的视角进行分析的精彩观点。

《管理金融风险》第三版是目前涵盖范围最广的风险管理教材。它既有当前产品和策略的新信息,又有来自工商巨子的撰稿,如英国石油公司、花旗银行、JP摩根银行、麦当劳公司、摩根斯坦利、安大略教师养老金计划等等。这本入选Irwin投资与金融系列丛书的著作,深刻而权威地涵盖了风险管理和衍生产品市场的所有方面。

《管理金融风险》

作者简介

查尔斯·W·史密森是CIBC世界市场部的执行董事，他在其中负责CIBC金融产品学院。查尔斯·W·史密森阅历丰富，他在学术界、政府机构和私营部门都工作过。在学术上，查尔斯曾于得克萨斯农工大学(A & M University)任教9年。

书籍目录

第一章 风险管理产品的演变

- 1.1 世界的风险变得越来越大
- 1.2 金融价格风险增大对企业的影响
- 1.3 预测者的失败
- 1.4 市场的反应：管理金融价格风险的工具
- 1.5 金融产品中有多少是真正的创新
- 1.6 结语

第2章 风险管理过程概览——对远期、期货、互换、期权和混杂证券的积木式理解

- 2.1 风险管理产品概览
- 2.2 远期合约
- 2.3 期货合约
- 2.4 互换合约
- 2.5 期权合约
- 2.6 金融积木箱

第3章 引入风险管理产品的影响

- 3.1 风险管理对标的资产市场的影响
- 3.2 风险管理对标的资产市场的影响
- 3.3 金融衍生产品市场相互间的影响

第4章 远期合约

- 4.1 远期合约的结构
- 4.2 远期定价结构
- 4.3 远期合约和违约
- 4.4 外汇远期
- 4.5 远期利率协议

第5章 远期合约的应用

- 5.1 市场
- 5.2 交易场所
- 5.3 终端用户

第6章 期货

- 6.1 期货合约
- 6.2 降低信用风险的制度性特征
- 6.3 提高流动性的制度特征
- 6.4 期货价格

第7章 期货的应用

- 7.1 使用期货对风险敞口进行套期保值
- 7.2 期限的不匹配：基差风险
- 7.3 期限的不匹配：条式和滚动套期保值
- 7.4 资产的不匹配：交叉套期保值
- 7.5 调整保证金账户：追踪套期保值
- 7.6 管理期货套期保值

第8章 互换

第9章 互换产品的应用

第10章 期权入门

第11章 第一代期权

第12章 期权的应用

第13章 第二代期权

第14章 设计“新”风险管理产品

- 第15章 混杂证券
- 第16章 交易商的视角
- 第17章 衡量和管理违约风险
- 第18章 衍生产品组合中的价格风险管理
- 第19章 风险治理
- 第20章 风险管理和非金融公司的价值
- 第21章 衡量非金融企业的金融风险敞口
- 第22章 实施风险管理方案
- 第23章 银行和其他金融机构对风险管理产品的使用
- 第24章 机构投资者对风险管理产品的使用
- 参考文献
- 索引
- 译后记

《管理金融风险》

精彩短评

- 1、了解金融的运作
- 2、对forward contract解释不够还有option put方面有点含糊。整本书设计到的Hedging部分就两个小点。忽悠人呢。。。
- 3、II

精彩书评

1、曾经依赖技术优势和营销技巧来进行有效竞争的企业，在过去20年遇到了一大堆新挑战。汇率、利率和商品价格的波动性——在很长一段时间中曾被认为对企业长期业绩的影响无足轻重——在今天的全球经济中已成为一个核心的战略要素。由于市场需要有效、可行的方法来控制金融价格风险(实际上是把风险转移给第三方)，于是出现了无数的远期、期货、互换、期权和混杂证券。在《管理金融风险——衍生产品、金融工程和价值最大化管理》中，风险管理者已经找到了他们需要的各种信息。由于这本重要和有影响力的著作，现在数以万计的金融专业人士已经理解并知道如何利用衍生产品，把这些威力巨大的工具用于降低风险和成本的项目。

《管理金融风险》

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.tushu000.com