

《高级风险管理》目录

序言

风险管理：定义和目的

第 1 章 综合风险管理：市场风险、信用风险、流动性风险以及资产负债管理

第 2 章 风险、收益和绩效

第 3 章 资本监管、风险管理和绩效

第 4 章 利率风险：导言和纵览

第 5 章 期限不匹配的利率风险与套期保值

第 6 章 传统利率风险分析：缺口分析和模拟模型

第 7 章 固定收益数学：基本工具

第 8 章 收益率曲线平滑

利率分析

第 9 章 久期与凸性

第 10 章 久期作为期限结构模型

第 11 章 Vasicek 与扩展 Vasicek 模型

第 12 章 其他可选的期限结构模型

第 13 章 期限结构模型的参数估计

信用风险模型

第 14 章 信用风险介绍：在贷款定价与绩效评估中使用市场信号

第 15 章 信用风险的传统方法：评级与转移矩阵

第 16 章 结构信用模型：Merton 方法介绍

第 17 章 简化型信用模型

第 18 章 信用价差的拟合和建模

利率和信用模型检验

第 19 章 使用历史数据检验信用模型

第 20 章 使用市场数据检验信用模型

第 21 章 运用信用风险方法检验利率模型

风险管理应用，逐个工具论述

第 22 章 信用风险债券估值

第 23 章 信用衍生工具和债务抵押债券

- 第 24 章 基于债券的欧式期权
- 第 25 章 远期和期货合约
- 第 26 章 基于远期和期货合约的欧式期权
- 第 27 章 利率上限和下限
- 第 28 章 利率互换和互换期权
- 第 29 章 奇异互换和期权的结构
- 第 30 章 美式固定收益期权
- 第 31 章 固定收益期权的非理性执行
- 第 32 章 抵押支持证券和资产支持证券
- 第 33 章 无限期存款
- 第 34 章 外汇市场：期限结构模型方法
- 第 35 章 估价模型中抵押品的影响
- 第 36 章 循环信贷及其他工具的定价和估值
- 第 37 章 违约调整基础上的普通股和可转债建模
- 第 38 章 保险单和养老金估值
- 第 39 章 投资组合和公司层面上的风险管理的目标
- 第 40 章 流动性风险分析和管理
- 第 41 章 绩效评价：加 Alpha 与转移定价
- 第 42 章 管理机构违约风险和“安全性和稳健性”
- 第 43 章 信息技术的考虑
- 第 44 章 股东价值的创造和毁灭