

<<金融网络中资金流动异常识别研究>>

图书基本信息

书名：<<金融网络中资金流动异常识别研究>>

13位ISBN编号：9787313081711

10位ISBN编号：7313081715

出版时间：2012-3

出版时间：上海交通大学出版社

作者：刘璇，李嘉，张朋柱 著

页数：172

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：<http://www.tushu007.com>

## <<金融网络中资金流动异常识别研究>>

### 内容概要

本书深入研究了在金融机构信息化、网络化和全球化背景下，分析、识别可疑资金流动的智能化金融监管模式、模型和方法，从而为金融机构和金融监管部门提供有效的决策支持工具。作者首先基于约束理论，分析了反洗钱业务流程中的主要瓶颈及其主要问题；再从账户层提出基于正常模板的资金流动异常识别方法；从交易层分别提出基于扫描统计和序列匹配的单账户资金流动异常识别方法；最后从网络层研究基于社会关系网络的多账户群异常资金流动识别方法。

本书适合金融行业研究者、从业者及相关监管部门政策制定者阅读参考。

书籍目录

第1章 绪论

- 1.1 研究背景
- 1.2 研究问题
- 1.3 研究意义
- 1.4 研究方法
- 1.5 主要创新之处

第2章 国内外研究现状述评

- 2.1 金融网络基本术语介绍
- 2.2 金融监管现状
- 2.3 对研究现状的评述

第3章 基于约束理论的反洗钱业务流程瓶颈研究

- 3.1 引言
- 3.2 我国反洗钱体系及机构分工
- 3.3 我国反洗钱业务过程中的主要约束
- 3.4 约束理论
- 3.5 反洗钱业务流程瓶颈研究
- 3.6 小结

第4章 基于正常模板的客户异常识别研究

- 4.1 引言
- 4.2 影响企业经营资金流动规律的多个因素
- 4.3 基于正常模板的企业交易行为判别
- 4.4 正常模板建立及应用
- 4.5 小结

第5章 基于聚类分析的客户异常识别研究

- 5.1 引言
- 5.2 反洗钱跨组织监测与聚类分析
- 5.3 反洗钱跨组织多层次监测体系
- 5.4 反洗钱跨组织多层次监测仿真分析及其效果评价
- 5.5 小结

第6章 基于扫描统计的单账户资金流动异常识别研究

- 6.1 引言
- 6.2 商业银行实施现行的管理办法的主要问题
- 6.3 扫描统计相关理论
- 6.4 利用扫描统计判别异常资金流动
- 6.5 实验
- 6.6 基于扫描统计的单账户资金流动异常实时识别
- 6.7 小结

第7章 基于序列匹配的单账户资金流动异常识别研究

- 7.1 引言
- 7.2 时间序列分析相关原理
- 7.3 基于序列匹配的异常资金流动识别算法
- 7.4 实验
- 7.5 小结

第8章 基于社会网络分析的多账户资金流动隐藏团体识别研究

- 8.1 引言

## <<金融网络中资金流动异常识别研究>>

8.2 监测中心大额、可疑资金分析

8.3 社会网络 ( social network ) 及相关研究

8.4 隐藏团体 ( hidden group )

8.5 金融网络描述

8.6 基于隐藏网络的金融网络隐藏团体识别

8.7 实验

8.8 小结

附录1：监管部门反洗钱 ( AML ) 调研

附录2：商业银行反洗钱 ( AML ) 调研

参考文献

编辑推荐

金融是现代经济的主要支柱之一，金融系统的稳定性更是世界各国金融监管部门的主要任务和核心职责之一。

金融信息化改变了传统的金融体制和业务模式。

金融机构信息化、网络化和全球化改变了金融机构的经营方式，金融网络中资金流动呈现速度快、数量大、创新多等特点，大量的资金在金融系统中流动着以满足正常的经济活动需求，但也夹杂着许多不正常、违规违法的资金流动，怀揣各种想法的资本所有者欲在金融网络中施展百般武艺，逃脱监管，达到资金违法流动的目的，给金融监管部门带来了空前的挑战。

《金融网络中资金流动异常识别研究》拟建立科学系统的分析、识别可疑资金流动的智能化的金融监管模式、模型、方法，为金融机构和金融监管部门提供有效的决策支持工具。

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:<http://www.tushu007.com>