

<<管理资本和 risk 的艺术>>

图书基本信息

书名：<<管理资本和 risk 的艺术>>

13位ISBN编号：9787504946669

10位ISBN编号：7504946664

出版时间：2008-1

出版时间：中国金融出版社

作者：克里斯托弗·L.卡尔普

页数：616

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>

## <<管理资本和风险的艺术>>

### 内容概要

保险和资本市场的融合成为一个术语至少已有十年了。

不幸的是，保险和衍生品的从业者们仍然使用十分不同的术语，甚至两个领域中最相似的概念也常常不被认为是本质上相同的东西。

本书通过将ART和资本市场放到一个共同的平台上，并统一现代公司融资的理论和实践框架，以试图帮助解决上述问题。

本书主要阐述结构性金融和结构性保险方面的内容，也就是非传统风险转移如何帮助公司通过综合和全面的方法实现公司融资和风险管理的目标。

全书共有五个部分，分别为综合风险和资本管理、传统风险转移、结构性金融、结构性保险和非传统风险转移、案例研究。

## <<管理资本和风险的艺术>>

### 作者简介

克里斯托弗·L.卡尔普，金融学博士，毕业于芝加哥大学商学院。  
现任位于芝加哥和瑞士伯尔尼的风险管理咨询服务股份有限公司（Risk Management Consulting Service, LNC.）的董事；位于华盛顿特区的竞争企业学会（Competitive Enterprise Institute）的金融监管方面的高级会员；芝加哥大学商学院金融学专业的兼职教授；以及伯尔尼大学金融管理研究所的荣誉教授（兼职教授）。

他为（再）保险公司和经纪公司、使用结构性产品的机构、资产管理公司和律师事务所等提供大量的结构性金融和保险方面的咨询服务，卡尔普以前在wiley出版社出版的著作有《风险转移：衍生品的理论和实践》、《风险管理过程》、《风险管理的艺术》和《公司余震》[与威廉·尼斯凯恩（William Niskanen）合著]。

## <<管理资本和 risk 的艺术>>

### 书籍目录

第一部分 综合风险和资本管理 第1章 实际和金融资本 第2章 风险和风险管理 第3章 财务杠杆 第4章 逆向选择与公司融资决策 第5章 资本预算、项目选择和绩效评价 第6章 风险转移 第7章 风险融资第二部分 传统风险转移 第8章 保险 第9章 再保险 第10章 信用保险和财务担保 第11章 衍生品 第12章 信用衍生品和信用连结票据第三部分 结构性金融. 第13章 结构化过程 第14章 混合证券、可转换证券和结构性票据 第15章 应急资本 第16章 证券化 第17章 现金债务抵押证券 第18章 合成债务抵押证券 第19章 结构性合成混合证券 第20章 私募股权和对冲基金的证券化 第21章 项目和本金融资第四部分 结构性保险和非传统风险转移 第22章 风险证券化和保险连结票据 第23章 自保公司、保护单列公司和相互公司 第24章 有限风险 第25章 多险种和多触发原因保险结构 第26章 应急保险第五部分 案例研究 第27章 专利法在风险融资中的新角色 第28章 天气衍生品和保险的主要区别 第29章 保险在新巴塞尔协议下是资本的替代物吗 第30章 特殊目的机构在FIN46R下是可变利益实体吗?如果是, 会怎么样 第31章 信用衍生品、保险和债务抵押证券: 安然事件余波 第32章 项目融资债务抵押证券 第33章 保险证券化趋势2004年回顾: 巨灾箱之外的探索 第34章 企业风险管理: 联合谷物种植公司案例 第35章 为推动公司交易而设计的告知和保证保险及其他保险产品附录A 资本结构的无关性附录B 关于金融机构的基于风险的资本监管附录C 风险资本注释常用缩略词参考文献译者后记

## <<管理资本和风险的藝術>>

### 媒体关注与评论

“现代企业每年必须决定保留何种风险以及规避何种风险，以保持竞争力和使资本价值最大化，这已成为一种趋势。

卡尔普在书中详细阐述了或通过资本负债平衡表机制如结构性金融和衍生品交易，或通过保险，进行风险转移的理论和实践。

股本十分昂贵，风险转移也十分昂贵。

随着对ART的更深层理解及应用，成本会持续降低，ART将继续作为减少可知风险的手段来替代股本。

本书十分有助于提高我们对ART的理解。

”——Myron S. Scholes, Frank E. Buck, 斯坦福大学商学院金融学荣誉退休教授 “对于那些将结构性金融作为经营业务的人来说，这是一本必须阅读的书；对于那些将使用结构性金融这种服务的人来说。

这更是一本值得阅读的书。

”——Norbert Johannin, 戴姆勒-克莱斯勒 (DaimlerChrysler) 金融服务公司执行董事 “

本书涵盖了目前公司所能够获得的非传统保险解决方法。

它重点阐述了非传统工具，如自保公司、租赁性自保公司和相互公司等现实好处以及在经济上和实践中的作用。

这是一本对复杂的非传统风险转移领域进行了精彩介绍的书。

”——Paul Wohrmann, 博士, 苏黎世金融服务公司欧洲区全球公司执行管理委员和卓越非传统风险转移中心主管 “这本书将单一的业务上升到企业的全面风险管理高度。

卡尔普十分详细地介绍了综合工具、自保公司、多触发因素和资本市场产品，同时提供了企业风险创新的建设蓝图。

”——Paul Wagner, AGL资源股份有限公司风险管理主管

<<管理资本和风险的艺术>>

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>