**大连海事大学硕士研究生入学考试大纲**

考试科目：金融风险管理

试卷满分及考试时间：试卷满分为100分，考试时间为180分钟。

一、**金融风险导论**

**考试内容**

1. 金融风险概述；

2. 金融风险识别与管理

**考试要求：**

1. 了解本课程研究的对象、内容；

2. 了解金融风险的基础知识，掌握风险识别的基本方法。

二、**金融风险测度工具与方法**

**考试内容**

1. 统计学基础

2. 金融风险测度概述

3. 风险价值（VaR）的计算方法与应用

4. 各种方法

**考试要求**

1. 了解金融风险计算的统计学基础；

2. 认识金融风险测度的基础知识点；

3. 归纳风险价值的三种计算方法并熟练应用进行实证分析。

三、信用风险

**考试内容**

1. 信用风险概述

2. 传统信用风险度量

3. 信用等级转移

4. KMV模型、CreditMetrics模型、CPV模型、CreditRist+模型

5. 信用风险管理

**考试要求**

1. 理解度量信用风险大小的基本参数及传统度量方法；

2. 掌握信用转移概率的计算；

3. 归纳主要的信用风险度量模型和方法及其适用范围；

4. 了解信用风险管理的常用方法。

四、**市场风险**

**考试内容**

1. 市场风险概述

2. 市场风险度量

3. 市场风险管理

**考试要求**

1. 了解市场风险的定义和分类；

2. 掌握市场风险度量方法并熟练应用；

3. 了解市场监测、报告与控制体系。

五、利率风险

**考试内容**

1. 利率风险概述

2. 利率风险度量

3. 利率风险管理

**考试要求**

1. 了解利率风险的定义并学会识别利率风险；

2. 掌握利率风险度量的基本方法并熟练应用；

3. 了解利率风险管理的基本理论并实证分析。

六、**流动性风险**

**考试内容**

1. 流动性风险概述、分类及来源

2. 流动性风险度量

3. 流动性风险管理

**考试要求**

1. 了解流动性风险分类及来源；

2. 归纳资产流动性风险度量方法；

3. 理解并掌握融资流动性风险度量方法；

4. 了解流动性风险管理策略与方法；

5. 掌握资产负债流动性管理与方法；

6. 了解金融机构现代流动性风险管理的步骤。

**参阅**：

（1）陆静 编著. 金融风险管理(第1版). 中国人民大学出版社, 2015

（2）约翰.赫尔（加），《风险管理与金融机构》，机械工业出版社，2013。