

# 南方科技大学

## 2019 年硕士研究生入学考试大纲

考试科目名称： 金融风险管理      考试科目代码：

### 一、考试要求

要求考生全面了解金融风险的多面性和金融机构体系，理解金融市场和以及相应的潜在风险。了解管理过程中需要确立管理目标、进行风险评价和风险控制及处置等步骤。

### 二、考试内容

#### 1. 金融市场与机构

- a) 银行、保险公司和各类基金
- b) 各机构对资本金的要求
- c) 各机构所面临的风险
- d) 2007 年信用危机

#### 2. 金融产品

- a) 资产的多头和空头
- b) 衍生产品市场
- c) 最基本的衍生产品
- d) 非传统衍生产品
- e) 结算所与保证金

#### 3. 希腊值的计算

- a) Delta
- b) Gamma
- c) Vega

- d) Theta
- e) Rho
- 4. 利率风险
- 5. 市场风险
  - a) 历史模拟法
  - b) 模型构建法
- 6. 波动率
- 7. 信用风险
  - a) 信用评级
  - b) 估测违约概率
  - c) 衍生产品中的对手信用风险及风险暴露
  - d) 双边交易清算和中心清算
  - e) 信用风险价值度
- 8. 操作风险
- 9. 流动性风险
  - a) 交易流动性风险
  - b) 融资流动性风险
  - c) 流动性黑洞
- 10. 模型风险
  - a) 盯市计价
  - b) 线性产品的模型
- 11. 风险价值度

- a) VaR 的定义与计算
  - b) 波动率的定义
  - c) 隐含波动率的定义
  - d) 指数加权移动平均模型
  - e) GARCH (1, 1) 模型
  - f) 最大似然估计法
  - g) 相关性与 Copula 函数
- 12. 经济资本金以及 RAROC
  - 13. 《巴塞尔协议 I》、《巴塞尔协议 II》和《偿付能力法案 II》
  - 14. 《巴塞尔协议 2.5》、《巴塞尔协议 III》和《多德-弗兰克法案》
  - 15. 情景分析和压力测试

### 三、试卷结构

- a) 考试时间： 180 分钟， 满分： 150 分
- b) 题型结构
  - a: 概念题 (30 分)
  - b: 计算题 (80 分)
  - c: 分析（或论述、或推证）题 (40 分)
- c) 考试语言： 英语
- d) 答题语言： 不限

### 四、参考书目

John Hull, 《Risk management and Financial Institutions》 4<sup>th</sup> Edition