

<<利率与汇率风险管理>>

图书基本信息

书名：<<利率与汇率风险管理>>

13位ISBN编号：9787115154545

10位ISBN编号：7115154546

出版时间：2006-12

出版单位：人民邮电出版社

作者：马杰

页数：180

字数：220000

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>

## <<利率与汇率风险管理>>

### 内容概要

本书以“新巴塞尔资本协议”的风险分类为构架，对市场风险、信用风险、操作风险、法律风险等基本金融风险及其防范措施进行了全面的阐述。

如何度量与管理因利率与汇率这两个基本金融变量变化所导致的金融风险，是本书的核心所在。

本书既可供金融从业人员以及研究金融风险管理的相关人士参阅，也可作为金融专业高年级本科生、研究生的教材。

<<利率与汇率风险管理>>

作者简介

马杰，1974——，湖北荆州人。

管理学博士，硕士生导师，曾任职于国家外汇管理局，现供职于北京航空航天大学经济管理学院。已发表中文核心期刊文章10多篇，负责或参与国家自然科学基金项目8项。

## <<利率与汇率风险管理>>

### 书籍目录

第1章 金融风险管理概述 风险概论 金融风险及其管理 “巴塞尔协议”对金融风险管理的巨大影响 金融风险管理的程序与组织框架第2章 金融风险管理的关键：风险度量 传统的风险度量技术 VaR的产生与基本概念 VaR的主要计算方法 金融风险度量方法的进一步发展第3章 利率风险的度量与管理 风险概述 基于利率期限结构与缺口分析的利率风险管理 基于持续期模型的利率风险度量与管理 利率变化对债券价格非线性影响的度量工具：凸性 基于衍生金融工具的利率风险度量与管理第4章 微观企业的汇率风险管理 汇率风险及其分类 汇率变动趋势判断的理论依据 基于内部风险防范的企业汇率风险管理 基于外部金融交易的企业汇率风险管理 汇率经济风险与会计风险的度量和管理第5章 中央银行面临的汇率风险及其防范 宏观的汇率风险与货币危机 几代货币危机模型的演变及其评价 央行如何防范汇率风险一：基于VaR方法的评估建模 央行如何防范宏观汇率风险二：货币危机的预警第6章 金融机构面临的其他风险及其管理 信用风险的度量与管理 操作风险的度量与管理 金融机构的法律风险及其管理参考文献

<<利率与汇率风险管理>>

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>