

<<美国商业银行利率风险管理>>

图书基本信息

书名：<<美国商业银行利率风险管理>>

13位ISBN编号：9787501728084

10位ISBN编号：7501728089

出版时间：2003-1

出版时间：中国经济出版社

作者：葛奇

页数：122

字数：100000

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>

## <<美国商业银行利率风险管理>>

### 内容概要

资产负债管理是商业银行经营管理的重要内容。

《商业银行资产负债管理系列丛书》沿着美国经济发展、美国银行业资产负债管理所走过的轨迹，从利率风险管理、汇率风险管理、流动性风险管理及资本金管理四个方面(分三本书)，向读者介绍美国商业银行资产负债管理的经济金融背景、管理理念、管理方法及其效果。

由于葛奇博士本人有对资产负债管理的亲身实践和曾在大学任教的经历，使得本书的风格不同于国内目前出版的介绍西方国家资产负债管理的其他书籍，更侧重于对银行风险防范管理理论和操作方法的介绍，特别是利率风险防范与控制，这不啻为有用的他山之石。

为配合人民银行全面推行资产负债管理的改革，中国银行从1995年起，开始对系统内管理干部进行资产负债管理方面的培训。

在纽约中行安排过几期高级管理干部培训，葛奇博士的授课受到大家的普遍好评。

本书的主要部分是当时使用的培训教材。

考虑到资产负债管理不仅是目前国内所有商业银行面临的新问题，也是国内所有金融机构的共同课题，书中的内容或许对各兄弟银行和金融机构都有参考价值，因此，我们把这本书推荐给金融界的各位同仁，希望它对同业的资产负债管理理论探讨与实践改革会有所启迪与帮助。

## <<美国商业银行利率风险管理>>

### 书籍目录

前言第一章 商业银行利率风险管理的演变过程 第一节 30年代至70年代银行没有必要进行利率风险管理 第二节 80年代利率风险管理学科迅速发展, 研究偏重于利率变动对银行利差的影响 第三节 90年代以来利率风险管理的任务是分析利率变动对银行资产、负债的市场价值及资本净值的影响第二章 如何制定资产负债管理政策 第一节 利率风险政策 第二节 投资政策 第三节 资本金政策 第四节 流动性政策第三章 如何识别和衡量各种利率风险 第一节 如何识别利率风险 一、成熟期不相匹配的风险(maturity—mismatch risk) 二、基本点风险(basis risk)三、净利息头寸风险(net interest position risk) 四、内含选择风险(embedded option risk) 五、收益曲线风险(yield curve risk) 第二节 如何衡量利率风险 一、缺口分析报告(gap report) 二、净存续期分析(net duration analysis) 三、净现值分析(net present value analysis) 四、动态模拟分析(dynamic simulation analysis) 第三节小结第四章 如何对利率风险进行管理 第一节 运用资产负债表内的不同组成部分控制利率风险 一、投资组合策略 二、利率制定和新产品开发策略 三、贷款组合策略 四、经纪存款策略 五、借入资金策略 六、小结 第二节 运用资产负债表外的项目控制利率风险 一、远期合同(forward contract) 二、期货合同(futures contract) 三、利率互换合同(interest rate swaps) 四、买入期权和卖出期权合同(calloption and put option) 五、利率上限和利率下限期权合同(caps and floors) 六、小结

<<美国商业银行利率风险管理>>

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>