第一图书网, tushu007.com

<<外汇储备与风险管理>>

图书基本信息

书名：<<外汇储备与风险管理>>

13位ISBN编号：9787543040854

10位ISBN编号：7543040859

出版时间：1970-1

出版时间：武汉出版社

作者：罗航

页数：328

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

内容概要

《外汇储备与风险管理》由七章组成。
第一章为导论，介绍外汇储备理论、风险管理理论、研究主题、分析方法和全书架构。
第二章和第三章为理论分析部分，分别论述外汇储备适度规模理论和外汇储备结构管理理论。
其中，第二章为外汇储备适度规模理论分析部分，确定了外汇储备适度规模区间的研究思路，第三章为外汇储备结构管理理论，论述了外汇储备的货币结构管理和资产结构管理理论。
第四章详细论述了金融机构的风险管理框架。
第五章介绍了国外外汇储备管理的经验与借鉴。
第六章根据我国外汇储备管理的现状，从适度规模、币种结构选择、资产优化配置等几个方面进行了深入地研究和探讨。
最后一章总结全文，阐述了在当前应对全球金融危机影响的情况下加强外汇储备管理的极端重要性，并对如何加强我国外汇储备的规模管理、结构管理和风险管理提出了政策建议。

作者简介

罗航博士毕业于新加坡南洋理工大学，获得经济学博士学位，是武汉大学经济与管理学院博士后，任教于澳大利亚拉筹伯大学经济与金融学院，担任博士生导师和研究生项目主任。
他还受邀担任武汉大学金融研究中心客座研究员、南京大学商学院高级访问学者、中南财经政法大学兼职教授。

书籍目录

第一章 导 论第一节 外汇储备理论概述第二节 风险管理理论概述第三节 研究主题1．外汇储备风险概述2．我国外汇储备快速增长中存在的风险第四节 分析方法与本文结构第二章 外汇储备适度规模的研究第一节 外汇储备适度规模的定性分析法1．比例分析法2．目标区分析法3．“衣柜效应”分析法4．定性分析法的国际比较第二节 外汇储备适度规模的回归分析法1．Frankel模型2．Iyoha模型第三节 外汇储备适度规模的成本收益分析法1．Heller模型2．Agarwal模型第四节 影响外汇储备规模的因素分析1．外汇储备的需求动机2．影响外汇储备规模的需求因素3．影响外汇储备规模的供给因素第三章 外汇储备结构管理的研究第一节 外汇储备货币结构管理理论1．影响外汇储备币种结构的因素2．外汇储备币种选择的Heller—Knight模型3．外汇储备币种选择的Dooley模型第二节 外汇储备资产结构管理理论1．基于均值一方差准则的资产选择理论2．基于极大极小决策准则的资产选择理论第四章 金融机构的风险管理框架第一节 信用风险1．信用风险的特点2．现代的信用风险管理3．传统信用风险管理模型4．现代信用风险管理模型5．现代信用风险管理模型的比较第二节 操作风险1．操作风险的分类2．操作风险的特点3．操作风险的管理原则4．操作风险的管理组织结构和管理过程5．操作风险的度量方法6．操作风险的度量模型第三节 市场风险1．市场风险与投资组合理论2．市场风险的度量3．波动率模型4．概率分布5．极值理论和Copula函数6．方差的讨论7．风险度量方式的选择8．回报率的边际分布第四节 汇率风险1．汇率风险的分类2．汇率风险管理的理论研究3．汇率风险的度量方法第五节 VaR模型及其在风险管理中的应用1．VaR模型的理论综述2．VaR的优缺点与应用3．VaR的计算方法第五章 外汇储备管理的国际比较第一节 欧元区的外汇储备管理第二节 新加坡的外汇储备管理第三节 日本的外汇储备管理第四节 韩国的外汇储备管理第五节 挪威的外汇储备管理第六节 国外外汇储备管理经验的借鉴第六章 我国外汇储备管理的现状与风险管理框架第一节 我国外汇储备的发展概况1．我国外汇储备持续增长的原因2．我国外汇储备管理面临的问题第二节 我国外汇储备适度规模的探讨1．我国外汇储备适度规模的静态模型2．我国外汇储备适度规模的动态模型第三节 我国外汇储备的币种结构选择1．我国外汇储备的币种选择2．我国外汇储备币别权重的确定第四节 我国外汇储备的资产优化配置1．外汇储备资产配置的基本原则2．我国外汇储备资产配置的原则3．我国外汇储备金融资产优化配置的路径4．我国外汇储备非金融资产优化配置的路径5．我国外汇储备资产优化配置的绩效评估第五节 中国投资公司（Chinese Investment Corporation）1．中投公司与外国主权财富基金的比较2．中投公司的SWOT分析3．中投公司的投资现状4．中投公司的投资策略建议5．中投公司的投资绩效评价第七章 结论与政策建议第一节 我国外汇储备的规模管理第二节 我国外汇储备的结构管理第三节 我国外汇储备的风险管理第四节 结语附 录外文参考文献中文参考文献后 记

编辑推荐

外汇储备管理的核心问题包括规模管理、结构管理和风险管理三个方面。
研究中国外汇储备适度规模问题有助于解决现实中外汇储备的管理和调控，有助于实现外汇储备稀缺资源的合理利用。
目前国内外在这方面的研究很多，从不同角度研究外汇储备的适度性问题，形成了比例法、储备需求函数法、成本收益法等。
本文则认为外汇储备适度规模不是一个具体数值，而是一个区间，并以外汇储备需求动机为基础，构建外汇储备最低规模模型，以成本收益理论为基础构建外汇储备最高规模模型，进而形成了外汇储备适度规模区间模型。

第一图书网, tushu007.com

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