第一图书网, tushu007.com

<<利率市场化与利率风险管理>>

图书基本信息

书名：<<利率市场化与利率风险管理>>

13位ISBN编号：9787810886178

10位ISBN编号：7810886177

出版时间：2006-11

出版时间：西南财经大学出版社

作者：解川波,尹志超

页数：210

字数：240000

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

2004年10月28日，是一个值得纪念的日子，这一天，中国人民银行宣布放开贷款利率上限和存款利率下限管理。
由此，中国的利率市场化进程迈出了实质性的一步。
此前，中国人民银行已经按照先货币市场和债券市场利率市场化，后存贷款利率市场化的总体思路逐渐放开了银行间同业拆借市场利率和债券市场利率。
因此，可以说中国已经驶入利率市场化的快车道。
伴随着中国利率市场化的实质性进展，利率风险随之而来。
从宏观上看，利率风险主要表现为利率的波动对金融体系和宏观经济的不利影响；从微观上看，利率风险将对商业银行的成本、收益和经济价值产生直接影响。
那么，如何在利率市场化的过程中防范和化解利率风险？
这是宏观和微观两个层面都必须关注的一个重大问题。
本书正是在这一背景下应运而生的。
本书从三个方面展开对利率市场化和利率风险管理的探讨：　　第一篇：利率市场化与利率风险。
本篇主要介绍基本的利率理论、世界各国的利率市场化、利率市场化对利率风险的影响、金融风险管理的基础知识和利率风险管理的相关概念等内容。
本篇知识是为后面两篇的学习做准备。
第二篇：利率风险的计量。
本篇主要是对利率风险计量的技术性介绍，目的是使大家对如何计量利率风险有一个全面认识。
本篇依次介绍利率风险计量中的缺口分析、持续期的计算、凸度分析、期权调整利差分析、在险价值（VAR）分析、情景分析和压力测试等方法，这些计量方法都是现代利率风险管理的必备方法。
第三篇：利率风险管理工具。
在对利率风险进行了计量和评估以后，利率风险管理的操作就需要相应的金融工具作为支撑。
随着现代金融市场的发展，利率风险管理工具日益复杂。
本篇主要介绍各种利率风险管理的金融工具，包括远期利率协议、利率期货、利率互换、利率期权等。
利率风险管理在国内是一个崭新的课题，相关的教材并不多见。
为了编写本书，我们参考了大量的文献。
从一定意义上说，本书是对相关文献的一个总结。

书籍目录

第一篇　利率市场化与利率风险　1　利率的基本理论　1.1　利率的含义　1.2　利率的种类　1.3　利率的计算　1.4　利率的决定　1.5　利率的结构　本章小结　2　利率市场化与利率风险　2.1　利率管制与利率市场化　2.2　利率市场化的实践　2.3　利率市场化与利率风险　本章小结　3　金融风险管理基础　3.1　金融风险概述　3.2　金融风险管理概述　3.3　金融风险管理的程序与方法　本章小结　4　利率风险管理概述　4.1　利率风险的定义　4.2　利率风险的种类　4.3　利率风险的产生　4.4　利率风险管理　本章小结第二篇　利率风险的计量　5　缺口分析与管理　5.1　缺口分析与缺口管理概述　5.2　利率敏感性缺口的度量　5.3　缺口分析的具体运用　5.4　缺口管理策略　5.5　对缺口分析的评价　本章小结　6　持续期理论与凸度的运用　6.1　持续期的基本概念与计算　6.2　持续期理论的修正与运用　6.3　持续期理论的扩展与运用　6.4　持续期模型的运用　6.5　凸度对持续期模型修正的进一步分析　本章小结　7　“期权调整利差“OA”　7.1　利率市场化及其隐含期权风险　7.2　隐舍期权对平均期限、持续期、凸度的影响　7.3　OAS对隐含期权债券利率风险的衡量　7.4　0AS在利率风险管理方面的具体应用　7.5　对OAS的评价　本章小结　8　VAR模型分析　8.1　VAR模型概述　8.2　VAR的计算　8.3　历史模拟模型　8.4　蒙特卡罗模拟模型　本章小结　9　情景分析和压力测试　9.1　情景分析方法　9.2　压力测试　本章小结第三篇　利率风险管理工具　10　远期利率协议　10.1　远期利率协议简介　10.2　远期利率协议的合约内容　10.3　全球远期利率协议市场　10.4　远期利率协议的应用与利率风险管理　本章小结　11　利率期货　11.1　利率期货概述　11.2　利率期货的交易　11.3　利率期货的风险管理　本章小结　12　利率互换　12.1　利率互换协议简介　12.2　利率互换产生的原因　12.3　利率互换在利率风险管理中的应用　本章小结　13　利率期权　13.1　利率期权概述　13.2　利率期权的主要分类　13.3　利率期权的运用　本章小结参考文献

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