

<<利率理论与利率风险管理>>

图书基本信息

书名：<<利率理论与利率风险管理>>

13位ISBN编号：9787300071817

10位ISBN编号：7300071813

出版时间：2006-5

出版时间：中国人民大学出版社

作者：胡曙光

页数：379

字数：278000

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>

## <<利率理论与利率风险管理>>

### 内容概要

随着金融创新的发展和经济环境的变化，许多国家纷纷放弃使用多年的以货币供应量作为货币政策中介目标的做法，改以利率作为中介目标。

现代银行理论认为，金融企业面临三种外部风险：利率风险、价格风险和汇率风险，所以，全面讨论利率理论与利率风险管理是有理论和实践价值的。

在利率理论方面，本书研究了马克思的利息理论和西方主流利率理论，如新古典利率理论、可贷资金理论、凯恩斯利率理论等，并研究了影响利率决定的宏观经济变量，如金融市场结构、货币政策等。本书在比较西方主要国家利率政策的基础上，论述了中国利率市场化过程中应注意的主要问题，并设想利率完全市场化之后的中国利率管理政策等。

在利率风险方面，本书主要介绍了利率风险的测量方法与规避利率风险的方法，如缺口法、持续期法、凸性值、利率期货期权及金融工程（结构化产品）等。

这部分技术性较强。

作为利率风险管理的基础——利率预测，本书则单独设章进行研究，主要介绍了贯序过滤法、信贷流量分析法等。

## <<利率理论与利率风险管理>>

### 作者简介

胡曙光，1967年生于安徽铜陵，2000年获得中国人民大学经济学博士学位并留校任教。中国人民大学副教授。  
2001年6 - 8月在法国政治大学作访问学者；2002年8月 - 2003年任韩国淑明女子大学客座教授。发表多篇专业论文，如《中外商业银行信贷资产质量管理模式的比较》等，与他人

## <<利率理论与利率风险管理>>

### 书籍目录

导论第一章 利率与利率决定理论 第一节 利息与资本 第二节 利率决定理论第二章 利率的度量及风险 第一节 利率的度量 第二节 利率风险第三章 影响利率决定的宏观经济变量 第一节 利率与金融市场 第二节 利率与宏观经济变量第四章 利率的预测与利率期限结构理论 第一节 定性分析方法 第二节 定量分析方法 第三节 利率期限结构理论第五章 利率风险的管理 第一节 规避利率风险的传统措施 第二节 规避利率风险的现代方法第六章 利率风险的解决之道——金融工程 第一节 金融工程概述 第二节 四种基本衍生工具及其之间的关系 第三节 金融工具及其结合 第四节 金融工程的未来第七章 利率变化对经济的影响 第一节 利率变化对经济发展的影响 第二节 利率变化对经济主体的影响第八章 利率政策传导机制 第一节 利率政策影响总产出量的传导路径 第二节 利率政策影响总体物价水平的传导路径 第三节 利率政策直接调整的是名义利率 第四节 利率政策顺畅传导的条件第九章 美国的利率政策.....第十章 日本的低利率政策及金融自由化第十一章 中国利率市场化参考书目后记

<<利率理论与利率风险管理>>

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>