

图书基本信息

书名：<<美国商业银行流动性风险和外汇风险管理>>

13位ISBN编号：9787501751198

10位ISBN编号：7501751196

出版时间：2003-5

出版时间：中国经济出版社

作者：葛奇

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

本书为《商业银行资产负债管理系列丛书》之二，分为上、下两篇。

本书欲通过对美国商业银行流动性风险和外汇风险管理的探讨，使读者至少了解以下几个问题：1．从银行的角度看，流动性风险究竟是什么？2．在美国银行之中，流动性管理的策略有什么不同，为什么会出现这些差异？3．流动性风险是否可以量化？如果可以，美国的银行在量度风险上采用了哪些方法？4．美国商业银行是如何制定流动性管理计划的？5．从银行的角度看，外汇风险的来源包括哪些方面？6．外汇风险是否可以衡量？美国银行如何通过表内和表外工具对外汇风险进行管理？总而言之，通过对流动性风险和外汇风险管理的分析，作者希望读者可以从不同的角度——银行投资者、授信者、管理者等——去分析、判断您所接触的银行的流动性风险和外汇风险和外汇风险管理的策略。

书籍目录

前言上篇 美国商业银行流动性风险管理 第一章 流动性的概念和缘由 第一节 流动性和流动性风险的概念 第二节 银行保持适当流动性的重要意义及流动性职能 第三节 流动性的供求结构 第四节 流动性风险产生的主要原因 第二章 流动性管理策略或理论的历史演变 第一节 商业贷款理论 第二节 资产变现或转移理论 第三节 预期收入理论 第四节 负债管理方法 第三章 美国商业银行的现代流动柱管理策略 第一节 资产流动性(资产变现)策略 第二节 负债流动性管理 第三节 美国银行业资产负债流动性管理策略的两个典型案例 第四节 美国银行业流动性管理的新动向 第四章 流动性风险的衡量 第一节 衡量流动性的简单比例 第二节 流动性的动态衡量方法 第三节 美国金融监管机构和评级机构对流动性风险的衡量方法 第五章 流动性计划 第一节 正常的流动性计划的制定过程 第二节 流动性计划涉及的预测行为 第三节 美国商业银行常用的预测方法 第四节 美国商业银行流动性管理中的储备金头寸计划管理 第五节 对付突发性流动性需求的应急计划 第六章 结束语：银行管理层在流动性管理中实际考虑的因素及指导原则 第一节 美国银行流动性管理决策中考虑的因素 第二节 流动性管理决策者应遵循的指导原则 [附录1]美国商业银行的资产证券化趋势 [附录2]利率掉期合同 [附录3]美国历史上银行流动性风险的经典案例 [附录4]简单回归分析法下篇 美国商业银行外汇[风险管理 第一章 外汇风险的缘由及其衡量 第一节 外汇交易 第二节 外币资产和外币负债 第三节 外汇风险的衡量 第二章 外汇风险的管理 第一节 表内套期保值 第二节 表外套期保值：利用远期外汇合同进行保值 第三节 表外套期保值：利用外汇期货合同进行保值 第四节 表外套期保值：利用期权合同进行保值 第五节 表外套期保值：利用货币互换合同进行保值主要参考文献

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>