

<<利率风险的控制与管理>>

图书基本信息

书名：<<利率风险的控制与管理>>

13位ISBN编号：9787505816022

10位ISBN编号：7505816020

出版时间：1999-03-01

出版时间：经济科学出版社

作者：[美] 科宁（Pornyn,A.G.）等编著，唐旭 等译

译者：唐旭

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>

<<利率风险的控制与管理>>

内容概要

本书主要列举了所有常用的利率风险控制与管理工具，描述了近20年来这一领域的变化轨迹，集合了美国众多商业银行、储蓄机构、抵押机构、保险公司等机构利率风险管理部門的管理智慧。

<<利率风险的控制与管理>>

书籍目录

第一篇 利率

1 利率简史

2 利率的期权结构

第二篇 利率风险管理技术

3 利率风险衡量和期权调整利差分析

4 有关持续期的错误理解

5 金融机构利率风险衡量的演变

6 估计无到期日存款的持续期

7 模拟的运用：应用与错误

8 情景分析与应用

第三篇 利率风险管理工具

9 运用利率协议

10 金融远期合同与期权合约

11 零息票收益曲线的构造技术

12 互换和互换期权

13 利率期权：上限期权、下限期权和双线期权

14 或有期权费期权：初级读本

15 结构性票据的作用

16 新型工具

17 利率风险管理的解决之道：金融工具

第四篇 特定领域的利率风险管理

18 商业银行的利率风险管理

19 储蓄机构的利率风险管理

20 用期权调整利差模型进行全球资产负债表管理

21 消费者存款行为和相关的利率风险

22 信用卡组合的利率风险管理

23 抵押银行业的利率风险管理

24 关于抵押的套期保值问题

25 当今的固定受益证券组合管理人员如何看待利率风险

第五篇 利率风险管理的特殊问题

26 企业整体风险管理方案下的利率风险管理

27 信用风险和利率风险的同步分析

28 利率风险管理战略

29 提高收益：获得超额利润

30 美国银行利率风险披露的质量和历史

31 运用关键利率持续期以发行的国库券对担保抵押债务进行套期保值

32 期限结构估计对利率衍生工具定价的影响

33 收益曲线非平行移动对银行资本充足率的影响

索引

<<利率风险的控制与管理>>

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>