

<<人民币外汇市场风险管理研究>>

图书基本信息

书名：<<人民币外汇市场风险管理研究>>

13位ISBN编号：9787509608548

10位ISBN编号：7509608546

出版时间：2012-10

出版时间：经济管理出版社

作者：梁建峰 等著

页数：235

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>

## <<人民币外汇市场风险管理研究>>

### 内容概要

《人民币外汇市场风险管理研究》由梁建峰、刘京军、田凤平所著，本书内容分为三部分，系统研究了人民币即期、远期市场的动态相关性特征及外汇风险管理策略。

第一部分研究了人民币远期市场有效性。

第二部分围绕人民币外汇衍生品市场的动态相关性，研究了多个市场之间的信息溢出、波动率影响以及外汇市场间的价格引导关系。

第三部分探讨了远期外汇市场的套期保值模型方法及套期效率等问题，研究了包括方差最小化静态及动态套期保值方法的改进、基于相对在险价值和下偏测度的套期保值优化以及套期保值的动态调整等问题。

本书在规范模型方法研究的同时，以各个人民币外汇市场的报价数据为基础，进行了深入的实证研究

。

<<人民币外汇市场风险管理研究>>

作者简介

梁建峰

女，博士，中山大学岭南学院副教授，从事金融工程与金融风险管理方面科研教学工作，主要研究领域为投资组合优化、金融风险管理等。

刘京军

男，博士，中山大学岭南学院副教授，主要研究领域为数理金融、金融经济学、金融风险管理等。

田凤平

女，博士，中山大学国际商学院讲师，主要研究领域为国际金融、金融工程与风险管理及金融计量分析等。

# <<人民币外汇市场风险管理研究>>

## 书籍目录

### 研究概述

#### 上篇 人民币外汇衍生品市场有效性研究

##### 第一章 基于半参数估计方法的远期外汇市场有效性研究

###### 第一节 引言

###### 第二节 模型和半参数估计方法

###### 第三节 人民币远期外汇市场有效性检验

###### 第四节 本章结论

##### 第二章 基于结构突变模型的外汇市场有效性研究

###### 第一节 引言

###### 第二节 外汇即期和远期协整关系及市场无偏性

###### 第三节 结构突变的协整模型及突变点检验

###### 第四节 结构突变检验结果分析

###### 第五节 人民币远期溢价水平估计

###### 第六节 本章结论

#### 中篇 人民币外汇市场的动态相关性研究

##### 第三章 人民币外汇市场的价格引导关系研究

###### ——基于DAG理论和VEC Granger检验

###### 第一节 引言

###### 第二节 文献回顾

###### 第三节 VEC Granger检验模型与方法

###### 第四节 人民币外汇市场实证研究结果与分析

###### 第五节 本章结论

##### 第四章 基于双变量EGARCH模型的境内外人民币远期市场信息溢出效应研究

###### 第一节 引言

###### 第二节 文献回顾

###### 第三节 NDF与境内远期外汇市场的实证检验

###### 第四节 结论与启示

##### 第五章 基于DCC-(BV)EGARCH模型的人民币外汇市场动态相关性研究

###### 第一节 引言

###### 第二节 文献回顾

###### 第三节 实证检验与结果分析

###### 第四节 结论与启示

##### 第六章 人民币远期市场价格发现功能的实证研究

###### 第一节 引言

###### 第二节 文献回顾

###### 第三节 共因子的价格发现

###### 第四节 价格发现应用模型与方法

###### 第五节 人民币远期市场价格发现的实证检验

###### 第六节 本章结论

#### 下篇 人民币外汇衍生品套期保值研究

##### 第七章 境内外人民币远期市场套期保值效率研究

###### 第一节 引言

###### 第二节 文献回顾

###### 第三节 数据描述与研究方法

###### 第四节 人民币远期套期保值的实证研究

## <<人民币外汇市场风险管理研究>>

第五节 实证结果分析及结论

第八章 人民币外汇市场多期套期保值研究

第一节 引言

第二节 文献回顾

第三节 多期套期保值研究模型与方法

第四节 人民币远期多期套期保值实证分析

第五节 本章结论

第九章 基于动态GARCH模型的套期保值绩效研究

第一节 引言

第二节 文献回顾

第三节 动态最优套期保值模型与绩效评价方法

第四节 境内外人民币远期套期保值的实证分析

第五节 本章结论

第十章 基于相对VaR的最优套期保值比率研究

第一节 引言

第二节 相对VaR下的最优套期保值比率

第三节 人民币远期套期保值效率比较

第四节 本章结论

第十一章 基于Copula-GARCH方法的LPM套期保值研究

第一节 引言

第二节 LPM风险度量在套期保值中的应用

第三节 分布拟合的基本方法

第四节 人民币远期外汇市场的实证研究

第五节 本章结论

总 结

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>