<<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门的管理智慧。

<<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