

<<我国商业银行利率风险管理研究>>

图书基本信息

书名：<<我国商业银行利率风险管理研究>>

13位ISBN编号：9787810985345

10位ISBN编号：7810985345

出版时间：2005-12

出版时间：上海财经大学出版社

作者：戴国强

页数：265

字数：206000

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>

## <<我国商业银行利率风险管理研究>>

### 内容概要

随着我国利率市场化进程的加快，我国商业银行也必将面临日益严重的利率风险，主要包括重新定价风险、内含选择期权风险和其他风险等。

选择市场基准利率、研究利率期限结构构造及进行利率预测，是商业银行利率风险管理的前提。

本书在总结金融市场基准利率基本属性和评析国外基准利率选择的基础上，围绕基准利率的四个属性，比较分析了我国利率体系中各种利率，并对相关利率之间进行了完整的Granger因果检验。

结果表明，银行间债券市场利率稳定性和主体的相关性优于交易所债券市场利率。

## <<我国商业银行利率风险管理研究>>

### 书籍目录

前言1 绪论 1.1 研究的背景与意义 1.2 研究的内容和方法2 我国利率市场化进程、制约因素与趋势预测 2.1 我国利率市场化的进程 2.2 我国目前在利率市场化进程中存在的不足 2.3 利率市场化趋势分析3 利率市场化背景下我国商业银行面临的利率风险及其管理现状 3.1 利率市场化与商业银行利率风险 3.2 商业银行利率风险成因分析 3.3 我国银行面临的利率风险分析 3.4 当前我国银行利率风险管理现状及其趋势分析4 我国商业银行利率风险管理中基准利率的选择、期限结构构造及利率预测 4.1 金融市场基准利率的基本属性及其车外基准利率选择概述 4.2 当前我国金融市场基准利率的比较选择及其计量检验 4.3 基准利率选择总结：以银行间债券市场回购利率 4.4 我国基准性即期收益率曲线的构造 4.5 利率预——利率风险控制的前提5 我国商业银行利率风险衡量方法 5.1 我国商业银行利率风险衡量现状 5.2 利率风险衡量方法及其选择 5.3 运用期限缺口法衡量银行的总体利率风险 5.4 运用持续期法衡量我国商业银行债券资产的利率风险 5.5 我国商业银行内含期权风险的衡量 5.6 VaR技术及其在商业银行利率风险管理中的应用6 我国商业银行利率风险控制方法 6.1 利率风险控制的表内调整法 6.2 利率风险控制的表外调整方法—金融衍生工具方法 6.3 内含期权风险控制7 利率风险监管模式 7.1 自律监管模式：BIS的利率风险监管原则 7.2 详细监管模式：OTS的利率风险管理方法 7.3 我国监管当局对利率风险监管模式选择8 我国利率风险管理研究总结 8.1 研究总结 8.2 加强我国商业银行利率风险管理的其他建议参考文献

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>