

<<银行外汇交易与风险管理>>

图书基本信息

书名：<<银行外汇交易与风险管理>>

13位ISBN编号：9787805315034

10位ISBN编号：7805315035

出版时间：1998-06

出版时间：文汇出版社

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>

## <<银行外汇交易与风险管理>>

### 书籍目录

#### 目录

#### 上篇 市场基础

#### 第一章 外汇市场

##### 第一节 外汇市场概述

- 一、外汇市场的基本概念
- 二、外汇市场的参与者
- 三、外汇市场的主要特点
- 四、世界主要外汇市场

##### 第二节 外汇与汇率

- 一、外汇的概念
- 二、汇率的概念
- 三、汇率的标价法
- 四、汇率的分类
- 五、交叉汇率的计算

#### 第二章 货币市场

##### 第一节 货币市场概况

- 一、货币市场
- 二、货币市场的参与者
- 三、货币市场的划分

##### 第二节 主要融资工具

- 一、同业拆放
- 二、短期国库券
- 三、可转让定期存单
- 四、商业本票
- 五、银行承兑汇票
- 六、贴现
- 七、回购协议和反回购协议

#### 中篇 外汇交易

#### 第三章 外汇买卖

##### 第一节 即期外汇买卖

- 一、外汇买卖
- 二、即期外汇买卖的概念
- 三、即期外汇买卖范例
- 四、即期外汇买卖的交易步骤
- 五、即期外汇买卖报价技巧

##### 第二节 远期外汇买卖

- 一、远期外汇买卖的概念
- 二、远期汇率
- 三、远期交叉汇率的计算
- 四、择期交易的汇率确定
- 五、远期外汇买卖实例

##### 第三节 调期外汇买卖

- 一、调期外汇买卖的概念
- 二、调期汇率的运用
- 三、不规则天数的调期汇率

## <<银行外汇交易与风险管理>>

四、调期外汇买卖交易实例

五、调期外汇买卖的应用

### 第四章 外汇期权

#### 第一节 外汇期权基本概念

一、期权的发展

二、外汇期权的概念

三、外汇期权的分类

四、外汇期权的要素

五、外汇期权交易实例

#### 第二节 标准外汇期权

一、买入买权

二、买入卖权

三、卖出买权

四、卖出卖权

#### 第三节 外汇期权的价格

一、外汇期权的价值

二、决定期权价格的主要因素

三、波动率

四、外汇期权定价模型

五、外汇期权的参数分析

#### 第四节 外汇期权组合

一、合成买权

二、合成卖权

三、同价对敲

四、异价对敲

五、看涨差额

六、看跌差额

七、蝶式差额

#### 第五节 非标准外汇期权

一、障碍期权

二、一揽子期权

三、平均价期权

四、数字式期权

五、其它

六、非标准期权的风险管理

### 第五章 金融互换

#### 第一节 货币互换

一、金融互换的产生

二、货币互换的概念

三、货币互换的运用

四、货币互换的风险

#### 第二节 利率互换

一、利率互换的产生

二、利率互换的概念

三、利率互换的运用

四、货币利率交叉互换

五、互换期权

## <<银行外汇交易与风险管理>>

### 第六章 其它金融工具

#### 第一节 金融期货

- 一、期货市场与期货交易
- 二、期货交易的特点
- 三、外汇期货合约
- 四、利率期货

#### 第二节 远期利率协议

- 一、远期利率协议的概念
- 二、远期利率协议的主要内容
- 三、远期利率协议的报价
- 四、远期利率协议的交割
- 五、交易实例
- 六、远期利率协议的应用

#### 第三节 利率期权及其它

- 一、利率期权
- 二、利率上限
- 三、利率下限
- 四、利率上下限

### 下篇 市场分析与风险管理

### 第七章 市场分析

#### 第一节 基础分析

- 一、经济因素
- 二、政治因素
- 三、其它因素

#### 第二节 技术分析

- 一、技术图表
- 二、趋势分析
- 三、形态分析
- 四、移动平均线分析
- 五、技术指标分析

### 第八章 风险管理

#### 第一节 外汇交易的风险分析

- 一、市场风险
- 二、信用风险
- 三、流动性风险
- 四、经营风险
- 五、法律风险

#### 第二节 交易室及其风险管理

- 一、交易室的基本组成
- 二、交易室的业务操作
- 三、交易室的风险管理

#### 第三节 企业财务与风险管理

- 一、财务部门的风险管理职能
- 二、汇率风险及其管理
- 三、利率风险及其管理

### 附录 世界各国货币名称一览表



<<银行外汇交易与风险管理>>

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>