

<<商业银行利率风险度量模型与管理模式研>>

图书基本信息

书名：<<商业银行利率风险度量模型与管理模式研究>>

13位ISBN编号：9787810887663

10位ISBN编号：7810887661

出版时间：2007-8

出版时间：西南财经大学出版社

作者：贺国生

页数：242

字数：205000

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>

## <<商业银行利率风险度量模型与管理模式研>>

### 内容概要

19世纪80年代，美国第一宾夕法尼亚银行和大陆伊利诺斯银行破产，让人们深切地感受到了利率风险的破坏性。

2003年下半年，我国众多商业银行因所持国债价格大幅下跌而遭受巨额损失，也让国人开始意识到，原以为与我们无关的利率风险，已悄然站到了我们面前。

对利率风险的研究，在我国已经不再只是有前瞻性的课题，而是有着重要的现实性。

为什么会有利率风险？

利率风险为什么会对商业银行产生如此大的破坏性？

利率风险度量与管理的机理是什么？

利率风险的管理在我国有着什么特殊性？

现有条件下我国商业银行对利率风险能有哪些作为？

哪些措施有助于改善利率风险管理的约束？

正是带着这些问题，作者撰写了本书《商业银行利率风险度量模型与管理模式研究》。

书籍目录

导论 第一节 选题背景及研究意义 第二节 研究方法 第三节 逻辑结构 第四节 主要观点及贡献 第五节 有待进一步研究的问题第二章 商业银行利率风险度量与管理的历史演变 第一节 商业银行利率风险的产生及演变 一、利息的本质及利率的决定 二、商业银行利率风险的产生及演变 第二节 商业银行利率风险度量的历史演变 一、单个证券和证券组合利率风险的度量 二、商业银行利率风险度量的历史演变 第三节 商业银行利率风险管理的历史演变 一、商业银行利率风险内部管理的历史演变 二、商业银行利率风险外部监管的历史演变 第二章 商业银行利率风险的度量基础——零息票债券收益率曲线的构建 第一节 零息票债券收益率曲线在利率风险度量中的基础作用 一、零息票债券收益率曲线是利率期限结构理论的分析基础 二、零息票债券收益率曲线是利率风险度量的标杆 第二节 现行静态零息票债券收益率曲线简单模型的构造 一、用直接法推导零息票债券收益率 二、用间接法推导零息票债券收益率 三、直接法和间接法的比较 第三节 动态零息票债券收益率曲线模型的构造 一、均衡模型 二、无套利模型第三章 商业银行利率风险的度量模型 第一节 常用的三种度量方法的比较分析 一、敏感性缺口法 二、持续期缺口法 三、模拟法 第二节 OAS模型 一、OAS模型的基本思想 二、OAS模型对利率风险的度量 .....第四章 商业银行利率风险的管理模式第五章 中国零息票债券收益率曲线模型的构造第六章 约束条件下中国商业银行利率风险的度量与管理附表附录参考文献后记

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>