

《中国商业银行汇率风险研究》

图书基本信息

书名：《中国商业银行汇率风险研究》

13位ISBN编号：9787504974420

出版时间：2014-1

作者：周浩

页数：150

版权说明：本站所提供下载的PDF图书仅提供预览和简介以及在线试读，请支持正版图书。

更多资源请访问：www.tushu000.com

《中国商业银行汇率风险研究》

内容概要

《金融博士论丛（第16辑）：中国商业银行汇率风险研究》从我国商业银行面临的汇率风险入手，从理论上探讨了商业银行汇率风险的形成机制，结合我国上市商业银行的实际情况，研究我国商业银行对汇率风险的识别、测度与管理方法，并借鉴发达国家商业银行成熟的汇率风险管理经验与教训，针对我国商业银行汇率风险管理中存在的问题提出了若干政策建议。

《中国商业银行汇率风险研究》

作者简介

周浩，1973年出生，安徽亳州人，副教授，经济学博士。现供职于中国人民银行合肥中心支行，2009年获得西南财经大学经济学博士学位（金融学专业），研究方向为金融理论与政策。近年来独立在《改革》、《财经科学》、《经济体制改革》等全国经济类核心期刊上发表论文十余篇，并作为主要研究人员参与国家社会科学基金重大项目、教育部人文社会科学基金项目、中国人民银行重点课题等多项研究，取得多项学术成果。

书籍目录

1 导论

1.1 问题的提出与选题意义

1.2 国内外研究现状

1.2.1 基于资本市场法的研究

1.2.2 基于现金流法的研究

1.2.3 基于风险价值法的研究

1.2.4 国内研究现状

1.3 本书的研究方法与框架结构

1.3.1 本书的研究方法

1.3.2 本书的逻辑框架

1.4 本书的主要创新点、局限性和进一步研究方向

1.4.1 本书的主要创新点

1.4.2 本书的局限性

1.4.3 进一步研究的方向

2 商业银行汇率风险及其生成机制

2.1 汇率风险和汇率决定理论

2.1.1 汇率风险

2.1.2 汇率决定理论

2.2 汇率风险和汇率制度

2.2.1 汇率制度的发展历史

2.2.2 汇率制度的选择

2.3 汇率风险生成机制

3 我国商业银行汇率风险的识别

3.1 汇率风险识别：资本市场法

3.1.1 模型设定

3.1.2 数据来源和计量方法

3.1.3 实证研究与分析

3.1.4 结果讨论

3.2 汇率风险识别：外汇敞口法

3.2.1 外汇敞口法

3.2.2 商业银行外汇敞口风险识别

3.2.3 外汇敞口法小结

3.3 两种汇率风险识别方法比较

4 我国商业银行汇率风险的测度

4.1 风险价值法产生的历史背景

4.2 对风险价值法的具体分析

4.2.1 风险价值法的定义

4.2.2 风险价值法的参数选择

4.2.3 风险价值法的估计方法

4.3 我国商业银行汇率波动风险的度量

4.3.1 AR-EGARCH-VaR模型设定

4.3.2 参数估计和数据分析

4.3.3 本节结论

5 商业银行汇率风险管理的国际经验

5.1 商业银行风险管理的发展

.....

6 我国商业银行汇率风险的管理

7 结论与政策建议

《中国商业银行汇率风险研究》

精彩短评

1、书中有一些错误，写作诚意一般吧，体现作者思想精华的部分不多。

《中国商业银行汇率风险研究》

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:www.tushu000.com