

外汇货币及衍生品市场的风险管理/金融学前沿系列



[外汇货币及衍生品市场的风险管理/金融学前沿系列 下载链接1](#)

著者:汉智

出版者:西南财经大学出版社

出版时间:2009-4

装帧:

isbn:9787811380347

《外汇、货币及衍生品市场的风险管理》通过对国际交易市场中的不确定性细节和复杂技术的剖析，为你获取国际市场的成功提供了简明扼要的方法，而无需你承受不可接受和常常无法觉察的风险。更明确地说，通过Heinz Riehl在世界各地的研讨会中成功运用的方法，这种重要的商业工具，连同大量的真实案例，能够迅速而便捷地获取信息。在《外汇、货币及衍生品市场的风险管理》一书中，Riehl一位国债和衍生品市场风险管理的专家，一位在诸多前沿技术领域中的国际知名专家通过适用的风险收益分析法将价格风险、信用风险及流动性风险真实地联结起来。“仅仅是赚钱已经不再够好了！”他说。每一章都包含切题的信息、经过时间验证的建议，相应的图表及对市场进行模拟的例子。不仅初学者，相关专家也能够学习到如何：

识别风险及估算其规模

管理及控制价格、信用和流动性风险：

挖掘机会：

辨识衍生产品：

判别新的金融产品的优点及隐患：

评估相应的交易对资产负债表和资本比率的影响：

防范人工误差及欺诈。

《外汇货币及衍生品市场的风险管理》还提供了大量关于在过去十年中金融市场如何发展变化及其原因，及如何预测未来趋势的知识。Riehl在通篇当中保持了其独特的视角，在聚焦于市场中的良好的发展的同时，也关注于“宏观层面的风险”。没有过多的信息，没有多余的数据，仅仅只有你达到成功所需的事项。这就是《外汇货币及衍生品市场的风险管理》之所有。正如Riehl所说：“暗含机遇的交易都将转换为风险—收益的衡量标准，使得人们能够清晰明了地如同他们自己拥有一家银行。”

作者介绍:

Heinz

Riehl，中文名黎汉智，是国债及衍生品市场风险管理中的国际级专家，又是Riehl世界培训咨询公司的创立者及主席。该公司作为一家致力于风险管理咨询的企业，为国际银行、中央银行及跨国公司提供咨询服务。除此之外，他还是纽约大学斯特恩商学院国际商务及财务助教。他也为金融交易的庭审辩论提供专家服务。他在花旗银行纽约分行服务了35年，曾担任过高级副主席及市场风险政策委员会的建立人及成员之一，并于1996年退休。Riehl多年以来还是纽约联邦储备银行外汇委员会及其风险管理二级委员会的成员之一。他也是McGraw—Hill公司出版的《外汇及货币市场》一书的合作者之一。

目录: 序

前言

致谢

第1章 现代银行的策略

管理目标：增加股东价值

收益来源

股本和财务杠杆

资本资产比率最佳平衡点

账户／产品盈利能力

银行的转变

注释

第2章 认识银行业发现价格风险

商品净头寸

利率

期权的波动率

注释

第3章 价格风险的测量

在任何时间点，盈亏状况如何？

交易投资组合的盯市

应计投资组合的估值

小结

第4章 评估价格风险规模

利润或损失会怎样变化？

评估交易头寸的价格风险规模

应计头寸价格风险估值

注释

第5章 波动率计算

计算方法

置信度和标准差
不同趋势下的波动率
废止期
小结
第6章 控制价格风险
在交易头寸中控制价格风险
在应计账户下控制价格风险
每日价格风险报告
压力测试
风险／收益分析
针对价格风险的股本权益配置
商业计划
管理外汇储备
共同基金的风险收益分析
注释
第7章 衍生产品的运用
对已经存在的价格风险进行对冲
创造性的借贷和投资
高杠杆的投机
交易对手的信用风险
中央银行对衍生产品的使用
注释
第8章 贷款及信用风险的清算
辨别、评估及控制信贷风险
发行人风险
交易中的信用风险
辨别清算风险
评估清算风险的大小
控制清算风险
注释
第9章 提前清算的信用风险
评估提前清算风险的规模
对远期合约进行定价
控制提前清算风险
信用互换
小结
第10章 国家风险
了解事务，认可国家风险
评价国家风险
为国家经营者和管理者提供的学校
第11章 期货
期货交易所
期货保证金
保证金规模的设定
在期货合约中放一尾巴
标准化
第12章 流动性风险管理
资金流动性风险
融资流动性风险管理
交易流动性
注释
第13章 资产负债表管理
风险加权制度
风险调整资产

资本资产率
注释
第14章 组织结构
组织结构图
集中与分散的贸易职能
高级管理层
第15章 内部控制：预防错误与欺诈
产品方案
责任分离
电话录音
场外交易
合计的合约触发点
过程控制
模型确认
费率的合理性过程
以历史利率续仓
顾客的适合度
授权交易
监管经纪人的关系
每年对公司和交易商行为的备忘录
强制的最短假期
总的想法
最后的建议
附录A 外汇交易活动指引
附录B 专业词汇
• • • • • ([收起](#))

[外汇货币及衍生品市场的风险管理/金融学前沿系列_下载链接1](#)

标签

外汇

金融

风险管理

经济

了解投资及投机

评论

[外汇货币及衍生品市场的风险管理/金融学前沿系列_下载链接1](#)

书评

[外汇货币及衍生品市场的风险管理/金融学前沿系列_下载链接1](#)