

国际贸易汇率风险度量与规避研究



[国际贸易汇率风险度量与规避研究 下载链接1](#)

著者:

出版者:

出版时间:2010-6

装帧:

isbn:9787562453819

《国际贸易汇率风险度量与规避研究》初步建立了企业国际贸易汇率风险度量及规避的

理论框架，通过算例计算分析了收汇额和收汇时间确定条件和不确定条件下的企业国际贸易汇率风险大小及规避措施，并根据研究分析的结论提出了相应的政策建议。

全书共四部分9章。第一部分引言（第1章）为问题的提出。介绍汇率制度及其发展历程，汇率风险度量与规避的现实意义和理论价值；简要介绍研究的主要内容、研究方法、创新之处等。

第二部分为“理论分析”（第2，3章）。在比较全面地综述国内外相关文献研究的基础上，系统分析了方差理论、风险价值（VAR和CVAR）理论、动态风险度量模型。对我国当前面临的汇率风险进行了深入的分析。

第三部分为“模型建立与算例分析”（第4，5，6，7章）。针对收汇额和收汇时间确定条件和不确定条件下的企业国际贸易汇率风险，在置信水平、收益和风险约束条件下，运用CVAR，WCVAR及动态规划模型分别建立了不同情况下的汇率风险度量模型，并通过算例分析了不同情况下的汇率风险大小。同时，提出了规避汇率风险的不同措施。

第四部分为“研究结论及展望”（第8，9章）。针对国际贸易中企业所面临的收汇期和收汇额不确定等情况，得出了企业国际贸易汇率风险大小的相关结论及其后续研究的展望。《国际贸易汇率风险度量与规避研究》试图在企业国际贸易汇率风险度量理论研究和实践方面有所创新。

作者介绍:

目录:

[国际贸易汇率风险度量与规避研究 下载链接1](#)

标签

评论

[国际贸易汇率风险度量与规避研究 下载链接1](#)

书评

[国际贸易汇率风险度量与规避研究 下载链接1](#)