

<<全球金融稳定报告>>

图书基本信息

书名：<<全球金融稳定报告>>

13位ISBN编号：9787504954855

10位ISBN编号：7504954853

出版时间：2010-5

出版时间：中国金融出版社

作者：国际货币基金组织

页数：208

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>

## <<全球金融稳定报告>>

### 内容概要

《全球金融稳定报告》（GFSR）评估全球金融体系面临的主要风险，从而识别系统脆弱性。正常时期，通过强调缓解系统性风险的政策，该报告希望对危机防范有所裨益，进而有助于全球金融稳定和基金组织成员国经济的持续增长。

本期报告讨论了金融危机的演进，评估了缓解危机对经济活动影响的政策。

展望未来，本期报告还提出了政策性建议，有助于全球金融体系在复苏之路上从容应对各种金融挑战。

## &lt;&lt;全球金融稳定报告&gt;&gt;

## 书籍目录

前言《世界经济展望》和《全球金融稳定报告》联合序言概要第一章 复苏之路 A.全球金融稳定图 B.全球金融体系在复苏路上面临的挑战 C.新兴市场在全球危机中破浪前行，但脆弱性仍存 D.信贷约束会阻碍复苏进程吗？

E.管理私人风险向主权资产负债表的转移 F.政策含义 附录1.1.全球金融稳定图：构建和方法 附录1.2.贷款损失和银行减记估计方法 附录1.3.估计核心银行的收益 附录1.4.美国、欧元区和英国信贷需求和信贷能力估计 附录1.5.金融危机对存款组合的影响——保险基金和养老基金 参考文献第二章 重启证券化市场：政策建议和缺陷 证券化的兴起、下降及衰落 旨在重启可持续证券化的政策倡议 结论和政策建议 附录2.1.最优的保留政策和资本要求 参考文献第三章 金融危机期间的市场干预：有效性如何及怎样解除干预？

危机期间的干预措施——市场对宣布干预措施的反应 对最初市场反应的追踪调查——干预措施的长期影响 日本在“失去的十年”后期的经历 退出：解除非常规政策的常规指引 结论和政策建议 附录3.1.金融和经济压力指数 附录3.2.事件研究法及其数据 参考文献词汇表附录 代理主席的总结发言统计附录专栏 专栏1.1.信贷损失估计的不确定性 专栏1.2.修补证券化对支持信贷供给至关重要 专栏1.3.增加的公共赤字、债务和债券收益 专栏1.4.恢复银行资本的水平和质量 专栏2.1.重启证券化的情况 专栏2.2.信用评级机构的监管新举措 专栏2.3.房地产抵押贷款投资管道的再证券化和再证券化的复苏 专栏2.4.抵补债券简介 专栏2.5.解释证券化风险 专栏2.6.巴塞尔新资本协议中与证券化和再证券化相关的升级 专栏2.7.贷款证券化最优保留政策 专栏3.1.非常规中央银行工具的使用 专栏3.2.20世纪90年代日本金融危机期间的干预政策 专栏3.3.将超额准备金作为对资金流动性考虑的指标 专栏3.4.中央银行资产负债表变化的含义表 表1.1.信贷市场利差 表1.2.按注册地分类的全球银行资产减记估计 表1.3.银行资本、盈利和减记额 表1.4.部分新兴市场国家的宏观和金融指标热度图 表1.5.非金融私人部门的信贷需求增长 表1.6.非金融部门净借款需求总额 表1.7.对非金融部门信贷能力和信贷需求的预期 表1.8.部分利差：当前和雷曼兄弟破产前的时期 表1.9.对欧元区国家普通风险因素的敏感度 表1.10.自2009年4月期《全球金融稳定报告》发布以来风险和条件的变化 表1.11.经合组织数据库：覆盖范围及合并的程度 表1.12.欧元区准备金率模型的统计结果 表1.13.按贷款类型预测的欧元区准备金率 表1.14.英国准备金率模型的统计结果 表1.15.2007-10年累计损失率 表1.16.证券指数目录 表1.17.欧元区居民住房证券市场 表1.18.美国居民住房证券市场 表1.19.回归结果：非金融私人部门和公共部门信贷需求 表1.20.美国成熟行业资金不足的现象更为严重 表1.21.部分国家强制性固定分配养老金资产 表1.22.部分国家总投资组合的股权份额 表1.23.部分国家强制性固定分配体系的实际表现 表1.24.部分国家违约投资期权的表现 表2.1.证券化政策进展报告 表2.2.美国：资产支持证券和抵押贷款支持证券的发行——债券保留的平均水平 表2.3.相对于理想化预期损失和巴塞尔新资本协议风险权重的信用评级 表2.4.假设努力水平为20%，计算信用档的规模（第一步和第二步） 表2.5.假设努力水平为31.2%，计算评级和风险权重（第三步）：中间档保留 表3.1.事件分级 表3.2.干预措施的数量 表3.3.危机干预措施的有效性 表3.4.危机干预措施对金融压力指数的有效性 表3.5.金融部门政策措施的有效性 表3.6.3个月期LIBOR一隔夜指数掉期（OIS）利差：从峰值下降 表3.7.管理中央银行资产负债表的补充操作 表3.8.金融部门措施的可逆性及其影响图 图1.1.全球金融稳定图 图1.2.热度图：系统性资产类别的发展 图1.3.公司利差变化的贡献度 图1.4.系统性银行违约风险 图1.5.资产价格波动和资金以及市场流动性 图1.6.实际私人部门复合借款利率和短期利率 图1.7.美国贷款的注销率 图1.8.欧元区：拨备率 图1.9.不同地区银行已实现预期的减记或损失拨备 图1.10.银行问题贷款和收入 图1.11.银行收益率 图1.12.银行资本需求 图1.13.成熟市场银行：债券债务的期限结构 图1.14.成熟市场：月度债券发行总数和担保债券发行数 图1.15.欧洲中央银行的再融资工具 图1.16.全球银行和保险公司股票指数 图1.17.主要股票指数中企业固定收益养老金计划的融资水平 图1.18.热度图：新兴市场系统性资产类别的发展 图1.19.对新兴市场主权对外债务利差变化的贡献度 图1.20.新兴欧洲信用违约掉期利差（2008年6月30日-2009年8月31日） 图1.21.净资本流入 图1.22.新兴市场：私人部门的银行信贷 图1.23.新兴市场以外汇计价的公司债务的再融资需求 图1.24.新兴市场不同部门的对外债券发行和评级 图1.25.新兴市场以外汇计价的公司债务的展期率 图1.26.新兴市场公司债券利差和投机级债券违约率 图1.27.新兴欧洲：不良贷款率 图1.28.私人部门信

## &lt;&lt;全球金融稳定报告&gt;&gt;

贷增长 图1.29.非金融部门债务的增长：历史和预期借款需求 图1.30.银行借贷能力的增长 图1.31.新兴市场储备积累 图1.32.成熟市场净主权债务发行 图1.33.国际资本市场上的新兴市场主权发行 图1.34.全球金融稳定图：货币和金融条件 图1.35.全球金融稳定图：风险偏好 图1.36.全球金融稳定图：宏观经济风险 图1.37.全球金融稳定图：新兴市场风险 图1.38.全球金融稳定图：信贷风险 图1.39.全球金融稳定图：市场风险和流动性风险 图1.40.贷款损失准备金 图1.41.欧元区银行贷款的估计份额，2007-10 图1.42.欧元区银行证券风险细分估计 图1.43.管理下的非银行固定收益资产的增长 图1.44.金融部门信用违约掉期利差 图1.45.2008年美国固定收益计划恶化的融资率 图2.1.证券化结构图 图2.2.按类型划分的全球私人证券化发行 图2.3.按类型划分的美国私人证券化发行 图2.4.按类型划分的私人证券化发行 图2.5.美国资产支持证券（ABS）和私人抵押贷款支持证券（MBS）的发行 图2.6.美国AAA级证券化工具信用利差 图2.7.美国政府资助企业与私人抵押贷款支持证券发行 图2.8.美国和欧洲以外私人证券化发行 图2.9.全球抵补债券发行 图2.10.部分抵补债券利差 图2.11.中介链示意图 图2.12.所有的AAAs都哪儿去了？

图2.13.美国发行的资产支持证券和抵押贷款支持证券 图3.1.样本国家危机措施时间图 图3.2.由金融压力指数反映的全球和美国危机干预措施的溢出 图3.3.美国：反作用干预措施对金融压力指数的影响 图3.4.政府担保债券（GGB）和非担保投资级银行债券 图3.5.债务担保对债券发行的影响 图3.6.美国：商业票据债务余额 图3.7.美国和欧洲的证券化 图3.8.信贷增长和银行放贷标准 图3.9.美国：美联储非常规措施的债务余额 图3.10.金融部门稳定措施对信用违约掉期（CDS）利差的影响 图3.11.抵押贷款利率 图3.12.银行部门对日本银行的经常账户差额 图3.13.日本存款保险公司援助的破产银行 图3.14.TIBOR和LIBOR的3个月期利差 图3.15.日本：银行贷款和消费价格指数 图3.16.中央银行资产负债表主要构成的变化

<<全球金融稳定报告>>

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>