

<<中国金融安全状态研究>>

图书基本信息

书名：<<中国金融安全状态研究>>

13位ISBN编号：9787504960467

10位ISBN编号：7504960462

出版时间：2011-9

出版时间：中国金融出版社

作者：聂富强 等著

页数：278

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>

## <<中国金融安全状态研究>>

### 内容概要

《中国金融安全状态研究:监测与预警》作为“中国金融国际化中的风险防范与金融安全研究”这个大课题下面的子项目,本研究一开始所承担的任务就是要力图回答金融危机能否避免、如果不能避免又能否预警、现有模型预警效果差强人意约束下如何探索方法上的创新以及中国当前与今后相当长时间内金融危机爆发的可能性等非常艰难的问题。

本研究在短期预警方法上相对于已有成果有所突破或者创新。

具体体现在两个方面:一是基于“症状监测”思路,首次提出了金融风险状态测度和预警的“相似度分析方法”,并通过信号分析法的提出者Kaminsky教授所提供的数据进行了验证,预警结论与之相比可以提前数月;二是从预警指标的选择入手,首次推论出基于敏感性与有效性相统一的核心指标体系选择思路,进而提出了一种基于预警指标选择过程的实用预警方法。

两种方法用于美国次贷危机进行样本外检验,均取得较好的预警效果且能相互印证。

经过对本研究有关结论的理性思考,结合相关研究和国际化速率不断加快背景下的我国经济现实问题分析,我们认为:走向市场经济的国家都难以避免金融危机的“诅咒”;中国金融安全状态虽无近虑,但有远忧;我国未来几年爆发金融危机的可能性不大,而在2030年前后遭遇首次金融危机将可能是一次大概率事件。

## <<中国金融安全状态研究>>

### 作者简介

聂富强，男，1964年生，教授、博士生导师，国家级重点学科(统计学)带头人之一。  
现任西南财经大学经济信息工程学院执行院长，四川省金融智能与金融工程重点实验室副主任；中国人民银行联合成立的中国支付体系研究中心理事暨副秘书长，中国信息经济学会信息管理专业委员会理事，四川省统计局专家委员会特聘专家，四川省学术和技术带头人后备人选。

主要研究领域为宏观经济问题分析与金融统计。

近年来，主持与主研国家社会科学基金、国家自然科学基金、联合国儿童基金会委托项目等各级课题20余项；在《金融研究》、《统计研究》、《数理统计与管理》等期刊发表论文20余篇；出版专著、教材10余部；科研成果获各级奖励10余项，其中省部级奖励7项。

# <<中国金融安全状态研究>>

## 书籍目录

### 第一章 导论

- 一、研究背景
  - 一、研究价值
  - 三、研究思路
  - 四、研究方法
  - 五、研究内容
- 参考文献

### 第二章 金融危机可以避免吗——基于国别经验证据的考察

#### 第一节 金融危机的识别以及分析方法的选择

- 一、金融危机的识别
- 二、分析方法的选择

#### 第二节 金融危机的时间分布

- 一、1825年至第二次世界大战结束时的金融危机
- 二、20世纪50年代末至80年代以前的金融危机
- 三、20世纪80年代的金融危机
- 四、20世纪90年代以来的金融危机
- 五、小结

#### 第三节 金融危机的空间分布

- 一、发达国家爆发的金融危机
- 二、发展中国家爆发的金融危机
- 三、发达国家和发展中国家的金融危机比较
- 四、小结

#### 第四节 结论：走向市场经济的经济体都难以避免金融危机的发生

- 一、世界典型的市场经济模式
- 二、世界经济体走向市场经济的金融改革
- 三、金融全球化进程中的风险与危机
- 四、结论

#### 参考文献

### 第三章 金融监测与预警方法的比较与选择

#### 第一节 金融稳健指标、压力测试和早期预警系统在次贷危机中的表现

- 一、金融稳健指标与次贷危机
- 二、压力测试与次贷危机
- 三、早期预警模型与次贷危机
- 四、结论

#### 第二节 EWSs研究述评

- 一、EWSs模型的一般方法论
- 二、EWSs模型的代表性方法
- 三、EWSs研究的总结与展望

#### 第三节 金融预警方法的具体选择

#### 参考文献

### 第四章 基于相似度分析法的金融风险状态测评

#### 第一节 绪论

#### 第二节 相关研究动态及述评，

#### 第三节 金融危机预警方法研究——相似度分析法

- 一、相似度分析法的基本思想

## <<中国金融安全状态研究>>

### 二、相似度分析法的实现过程

#### 第四节 基于相似度分析法的金融风险状态实证分析

##### 一、危机样本和指标选取

##### 二、金融系统的运行与危机前一般状态的相似度分析

##### 三、相似度分析法的样本内检验

#### 第五节 相似度分析法的样本外检验和中国实践

##### 一、美国金融危机预警的实证分析

##### 二、中国爆发金融危机的可能性的测度

#### 第六节 相似度分析法研究展望

##### 一、指标的选取问题

##### 二、与该方法效果评价相关的统计检验

##### 三、为金融危机机理分析提供统计依据

#### 参考文献

### 第五章 金融危机预警指标的选取和应用——有效性与敏感性的统

#### 第一节 绪论

##### 一、引言

##### 二、金融危机预警指标优良性的判断：有效性还是敏感性

##### 三、研究思路与步骤

#### 第二节 相关研究动态及述评

#### 第三节 金融危机预警指标的有效性分析

##### 一、金融危机预警指标有效性的统计判断

##### 二、金融危机预警指标的有效性分析——基于危机成本衡量样本的分析

##### 三、小结

#### 第四节 金融危机预警指标的敏感性分析

##### 一、金融危机预警指标的敏感性分析方法选择

##### 二、金融危机预警指标的敏感性实证——基于危机成本衡量样本下的分析

##### 三、小结

#### 第五节 优良预警指标的样本外检验

##### 一、美国次贷危机验证

##### 二、中国未来两年发生金融危机的可能性实证

#### 第六节 结语

##### 一、主要结论

##### 二、研究的不足之处

#### 参考文献

#### 附录

##### 附表1 印度尼西亚时差相关分析结果表

##### 附表2 泰国时差相关分析结果表

##### 附表3 菲律宾时差相关分析结果表

##### 附表4 马来西亚时差相关分析结果表

##### 附表5 墨西哥时差相关分析结果表

##### 附表6 巴西时差相关分析结果表

##### 附表7 西班牙时差相关分析结果表

##### 附表8 瑞典时差相关分析结果表

##### 附表9 芬兰时差相关分析结果表

### 第六章 金融危机爆发环境特点的数量分析——以危机成本的衡量为视角

#### 第一节 绪论

#### 第二节 相关研究动态及述评

## <<中国金融安全状态研究>>

### 一、金融危机理论研究述评

### 二、一个新视角——金融危机成本视角

### 三、危机成本的参数估计方法综述

### 四、参数估计方法评论

#### 第三节 金融危机成本的衡量

##### 一、什么是危机成本

##### 二、衡量金融危机成本的说明

##### 三、对世界主要金融危机国家危机成本的衡量

#### 第四节 金融危机爆发环境的数量分析

##### 一、经济环境指标的选取

##### 二、金融危机孕育环境的特点分析

##### 三、不同程度的金融危机爆发前的环境特点

##### 四、小结

#### 第五节 样本外检验与预测

##### 一、美国次贷危机的样本外验证

##### 二、基于参数模型的中国金融安全环境的进一步分析

##### 三、研究展望

#### 参考文献

## 第七章 金融危机预警应用研究的长期视角——基于经济周期与金融危机的相互联系

### 第一节 绪论

### 第二节 相关研究动态及述评

#### 一、经济周期性波动是否孕育着金融危机

#### 二、现代经济周期中金融危机的成因研究

#### 三、研究现状的评价

### 第三节 金融危机与经济周期关系的初步验证

#### 一、样本与指标的选择

#### 二、经济周期趋势分解方法选择

#### 三、统计结果与分析

#### 四、以东亚五国经济周期为典型

### 第四节 经济周期视角下爆发金融危机的影响因素分析

#### 一、经济周期视角下金融危机爆发的影响因素分析

#### 二、个案再剖析——亚洲金融危机

#### 三、小结

### 第五节 中国爆发金融危机的可能性

#### 一、中国长期经济增长的形势判断——一个综述

#### 二、长期来看中国爆发金融危机的可能性——一个预判

#### 三、中国经济面临的外部冲击——一个推动力

#### 参考文献

## 第八章 进一步完善中国金融安全监测预警体系的若干思考与建议

### 第一节 中国金融安全状态：虽无近虑，但有远忧

#### 一、不可避免的金融危机——“立体”的国别经验考察

#### 二、未来几年爆发金融危机的可能性不大——多视角下的统计证据

#### 三、2030年前后遭遇首次金融危机的可能性很大——经济周期视角下的大胆假设

### 第二节 中国金融安全预警系统存在的问题

#### 一、预警信息基础存在的问题

#### 二、预警指标选取存在的问题

#### 三、预警方法存在的问题

## <<中国金融安全状态研究>>

### 四、预警制度层面存在的问题

#### 第三节 进一步完善我国金融安全监测预警体系的建议

- 一、进一步完善我国金融安全预警的信息基础
- 二、进一步完善我国金融安全预警指标体系和预警方法选择
- 三、进一步完善我国金融安全预警的制度保障建设

#### 参考文献

## &lt;&lt;中国金融安全状态研究&gt;&gt;

## 章节摘录

随着现今经济金融国际化、全球化越来越深入，中国与世界的联系也越来越紧密，在获得巨大机遇的同时也面临着诸多风险和不确定性因素。

中国虽然历史上并没有发生过较为严重的金融危机，但是过去没有发生并不意味着未来没有发生危机的可能。

我国在国际化 and 市场化进程中也面临着防范金融危机的现实问题和挑战。

中国正处在由发展中国家向发达国家过渡、由计划经济体制向市场经济体制转型的特殊历史阶段，经济的高速发展和制度的全面变迁必然导致金融风险的种类、性质、分布及传导机制的频繁变动，风险问题日益突出和复杂。

特别是在加入WTO后，随着过渡期安排的结束，国内金融业全面开放的趋势不可逆转，一方面其他国家或地区的金融风险会通过多种途径传递到国内，加大外在不确定性的影响；另一方面经济全球化也会带来很多新的内在不确定性，改变国内金融风险的状况。

针对我国金融体系的脆弱性，不少学者甚至预言，未来10年中国发生金融危机的概率为1。

近年来，国内金融体系的开放措施引起了广泛的争议，如商业银行改革中引进外国战略投资者带来的控制权问题、资本市场的开放与稳定发展问题、大型国企海外集中上市导致国内资本市场边缘化问题、国内衍生金融市场的发展（如期货市场）与定价权问题，等等。

这些问题争议的焦点在于金融国际化对国家安全的影响。

防范金融危机是一个系统性的工程，而其中的关键环节就在于对整个金融系统的风险安全状态进行准确判断，对相应风险指标进行动态监测，在危机发生之前的适当时机发出预警信号，以便相关经济主体能够及时采取措施化解或降低危机造成的损失。

本章试图在批判继承国外现有相关研究成果的基础上，以历史危机事件为出发点，以各个危机事件前金融系统运行路径及状态的相似性为突破口，探索金融危机爆发的一般规律，进而为中国构建自己的金融危机预警系统提供一些参考。

本章的研究内容主要涉及两个方面：第一，在对相关金融预警模型方法进行深入分析的基础上探讨新预警思路下新方法的实现，以及对该方法效果进行评价。

第二，应用新方法对中国在一段时期内的金融安全状态和爆发金融危机的可能性进行判断。

在研究方法的选择上，传统的金融危机预警研究模式都是建立在危机分类基础上的，然而美国此次金融危机已经突破了传统危机范畴，这说明以前的研究方法已经凸显了其局限性，因此在研究方法上要求创新成为必然。

.....



<<中国金融安全状态研究>>

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:<http://www.tushu007.com>