

<<宏观金融风险管理>>

图书基本信息

书名：<<宏观金融风险管理>>

13位ISBN编号：9787509541524

10位ISBN编号：7509541522

出版时间：2012-12

出版时间：中国财政经济出版社一

作者：杨廷干

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>

<<宏观金融风险管理>>

内容概要

本书从统计方法论视角展开宏观金融风险管理的系统研究。

<<宏观金融风险管理>>

书籍目录

第一章 宏观金融风险及其管理系统 第一节 宏观金融风险的本质特征与管理理念演变 第二节 宏观金融风险的理论与模型：文献综述 第三节 金融危机给我们的启示：剖析一个新样本 第四节 宏观金融风险管理模块构成及其实施的有效性 第二章 宏观金融风险的识别和测度 第一节 宏观金融风险冲击来源的识别与诊断 第二节 支付系统的有效性和安全性 第三节 资产负债表渠道传导的金融风险：矩阵法的改进 第四节 银行系统性风险：双因素GARCH模型的改进 第五节 VaR在宏观金融风险管理中的应用 第六节 对保险市场宏观金融风险的研究 第七节 宏观金融风险的跨国传染 第八节 宏观金融危机发生概率计算：莱哈尔风险管理法 第三章 宏观金融风险的预警和监测（一） 第一节 CAMELS、BASEL协议与FSAP：指标体系与监管理念比较 第二节 货币与金融统计国际规范的风险管理理念 第三节 宏观金融风险预警与监测指标体系研究 第四节 宏观金融风险预警与监测模型 第四章 宏观金融风险的预警和监测（二） 第一节 极端条件下的宏观金融风险与压力测试 第二节 基于cGE模型的宏观金融压力测试模型 第三节 压力测试情景模拟及结果解读 第五章 宏观金融风险管理中内外均衡的实现 第一节 风险管理的分析工具：国民收入账户与国际收支账户 第二节 内外均衡的冲突与风险管理的政策搭配 第三节 商品市场、货币市场和外汇市场的同步均衡 第四节 货币危机、债务危机与经济外部均衡 第六章 中国宏观金融风险管理 第一节 中国宏观金融风险的生成特点 第二节 强化市场纪律，夯实宏观金融风险管理的微观基础 第三节 改善金融生态，优化宏观金融风险管理的社会环境 第四节 宏观金融风险管理的有效协调与功能完善 第五节 开放条件下的宏观金融风险管理参考文献附表后记

<<宏观金融风险管理>>

编辑推荐

杨廷干等所著的《宏观金融风险管理——识别测度与监管》从数据源、模型构造、管理工具设计等方面较为全面地讨论了宏观金融风险的预警和监测问题。

在CAMELS、BA—SEL、FSAP风险管理理念、设计思想和主要功能的比对基础上，设计了宏观金融风险预警与监测的指标库结构；采用聚类分析、非参数检验、相关分析等办法，设计指标的筛选流程，用以保证指标的代表性和指标体系的全面性；为解决传统金融风险预警中很难客观确定权重和阈值的难题，本书选择sVDD预警模型，基于流程筛选出的指标体系，对我国1995～2000年的运行情况进行实证，SVDD方法可以有效解决缺乏非正常样本数据的困难。

<<宏观金融风险管理>>

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>