第一图书网, tushu007.com

<<中国巨灾债券运作机制与定价研究>>

图书基本信息

书名：<<中国巨灾债券运作机制与定价研究>>

13位ISBN编号：9787560849997

10位ISBN编号：7560849997

出版时间：2012-12

作者：李永

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

内容概要

巨灾债券是当前国际保险领域一项重要创新产品，通过在资本市场构建和发行保险连接型证券，实现巨灾风险在资本市场分散，从而使资本市场投资者成为真正风险承担的主体，对一国巨灾保险市场起到重要的补充作用。
《中国巨灾债券运作机制与定价研究》(作者李永、刘鹃)在探讨巨灾保险理论创新和国际市场巨灾债券实践运作的基础上，以制度分析框架为依托，分析了中国发行巨灾债券的现实性、运作模式和交易结构，设计了中国台风债券产品；介绍巨灾债券定价模型，并完成了中国台风巨灾债券的设计与定价研究；提出了中国巨灾债券市场制度建设的框架思路与重点举措。
《中国巨灾债券运作机制与定价研究》对改善中国巨灾保险困境。
实现巨灾保险产品创新具有一定参考作用。

书籍目录

总序
前言
第一章 绪论
第一节 研究背景与意义
一、选题背景
二、研究意义
第二节 文献综述
一、巨灾风险的可保性与再保险机制
二、巨灾债券的运作机制
三、巨灾债券定价摸型
四、国内外研究文献评述
第三节 研究方案与内容安排
一、研究内容、方法和技术路线
二、本书结构安排
第二章 巨灾债券研究的理论基础
第一节 风险可保性理论及其扩展
一、风险可保性理论
二、风险可保性理论的扩展
第二节 保险金融中介功能论
一、金融中介论及其发展
二、保险功能论
三、保险金融功能论的阐释’
第三节 新制度经济学的制度变迁与效率评价理论
一、新制度经济学的制度变迁理论
二、效率评价的制度分析
三、巨灾债券的制度变迁特征
第三章 巨灾债券运作的制度分析框架
第一节 巨灾债券制度产生的动力机制
一、动因与制度需求
二、外部收益：巨灾债券与再保险制度的比较
三、推动力和制度供给
第二节 巨灾债券的制度结构与效率
一、巨灾债券运行机制的制度安排
二、制度环境与实施条件
三、巨灾债券制度创新的效率分析
第三节 中国巨灾债券制度创新的分析框架,
一、中国保险市场的特殊性
二、中国巨灾债券制度创新的重点
第四章 中国巨灾保险市场现状分析
第一节 自然灾害现状与损失补偿途径
一、自然灾害损失度量
二、台风灾害损失特征
三、巨灾损失补偿途径
第二节 巨灾保险制度缺位与承保能力不足
一、巨灾保险制度缺位

二、巨灾保险承保能力不足
第三节 巨灾保险市场低效率的主要制约因素
一、偿付能力监管有效性的实证检验
二、政府监管失灵的根源探究
第四节 巨灾债券是中国保险业的现实选择
一、制度变迁的需求分析
二、制度变迁的供给分析
第五章 中国巨灾债券的运作机制与交易结构
第一节 臣灾债券运作以巨灾保险制度为基础
一、巨灾债券创新与巨灾保险制度的关系
二、政府在巨灾保险制度中的定位与作用
第二节 巨灾债券运作机制的构建
一、巨灾债券的运作机制
二、运行架构与市场主体
第三节 巨灾债券产品要素与结构
一、巨灾债券产品的国际案例
二，中国巨灾债券产品要素结构
三、触发机制构建
四、巨灾模型与债券评级
第四节 中国台风巨灾债券设计示例
一、市场假设
二、产品设计示例
第六章 巨灾债券定价模型构建
第一节 巨灾债券定价模型分析
一、巨灾债券定价模型的框架与分类
二、巨灾损失模块定价分析
三、金融模块定价分析
四、市场因素对定价模型的影响
第二节 对巨灾损失模型的完善
一、损失程度与损失频率分布
二、损失聚合风险模型
第三节 对利率定价模型的改进与扩展
第四节 巨灾债券定价模型的构建
一、模型假设
二、定价模型的构建
第七章 中国台风巨灾债券的定价实证模拟
第一节 台风损失分布模型的确定
一、损失额分布模型
二、损失次数分布拟合
三、聚合风险模型
第二节 台风巨灾债券定价实证
一、远期利率的动态模拟
二、单触发值债券
三、多级触发值债券
第三节 敏感性分析
一、利率敏感性分析
二、模型参数对价格的敏感性分析

三、敏感性对产品设计的启示
第八章 中国巨灾债券市场制度环境建设
第一节 中国巨灾债券制度创新的效率改进分析
一、巨灾保险市场的效率改进
二、政府与国家财政的效率分析
三、消费者群体的效用分析
四、资本市场投资者的效率改进
第二节 巨灾债券监管制度创新
一、监管制度创新的必要性
二、监管创新的方法与举措
第三节 交易制度创新：建立保险交易中心
一、建立保险交易中心的必要性
二、交易中心的建设框架
三、交易中心建设的措施
第四节 外部制度环境体系的构建
一、建立政府支持和鼓励机制
二、完善巨灾债券法律制度
三、建立健全税惠制度
第九章 结论与展望
第一节 主要结论
第二节 研究不足与展望
附录一 金融定价模型中的随机过程
附录二 中国1990-2008年历次台风灾害强度及经济损失
附录三 中国1969-2008年历次地震灾害的经济损失
参考文献

第一图书网, tushu007.com

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