

<<宏观金融工程>>

图书基本信息

书名：<<宏观金融工程>>

13位ISBN编号：9787040333541

10位ISBN编号：7040333546

出版时间：2011-7

出版时间：高等教育出版社

作者：叶永刚,宋凌峰,张培

页数：328

字数：390000

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>

<<宏观金融工程>>

内容概要

《宏观金融工程:理论卷》是2007年度教育部哲学社会科学研究后期资助重大项目“宏观金融工程研究”的研究成果。

《宏观金融工程:理论卷》在系统整理金融工程领域最新成果和深入研究风险管理理论的基础上,首次提出了宏观金融工程的理论和分析框架。

宏观金融工程将整个经济体作为分析对象,以部门结构为依托,从宏观资产负债表、宏观金融风险管理和宏观经济资本管理三个层面分析国家金融风险和金融资源的使用状况,并通过金融工具、手段、机制、结构等的创新为经济体系带来活力。

宏观金融工程不仅是国家金融风险管理系统,而且是国家经营管理系统,可以为宏观经济稳定健康发展和国家金融安全提供支撑。

《宏观金融工程:理论卷》适合于金融风险与发展相关领域的研究人员阅读参考。

作者简介

叶永刚，男，1955年生，湖北省武汉市人。

武汉大学经济与管理学院副院长、教授、博士生导师。

现任中国金融年会常务理事、中国金融学会理事、中国金融学会金融工程专业委员会常务委员，是国内较早从事金融工程研究的金融学家之一。

主要研究方向为衍生工具、风险管理和金融发展。

曾主持编著金融工程丛书，包括衍生工具、金融工具配置和金融工程本土化三个系列，近二十本学术专著。

先后主持教育部人文社会科学研究基金项目、国家自然科学基金项目和中国建设银行项目等，在《金融研究》、《保险研究》、《经济学动态》等刊物发表学术论文数十篇。

<<宏观金融工程>>

书籍目录

第1章 宏观金融工程概述

第1节 宏观金融工程的界定和基本内涵

- 一、金融工程的概念和内涵
- 二、微观金融工程与宏观金融工程的关系

第2节 宏观金融工程研究的框架

- 一、宏观金融工程研究的总体框架
- 二、宏观金融资产负债表研究的主要内容
- 三、宏观金融风险研究的主要内容
- 四、宏观经济资本管理研究的主要内容
- 五、宏观金融工程研究的基本技术和方法

第3节 本书的研究思路、结构安排与主要内容

- 一、本书的研究目标与思路
- 二、本书的结构安排与主要内容

第4节 本书的创新与进一步研究方向

- 一、本书的创新
- 二、本书的进一步研究方向

第2章 金融稳定性和宏观金融风险的定量研究方法

第1节 金融稳定性和金融风险的理论分析

- 一、金融稳定性和金融安全
- 二、宏观金融风险的定义
- 三、金融危机理论模型

第2节 金融稳定和宏观金融风险的指标评价法

- 一、单个银行稳健性评价的CAMELS指标
- 二、IMF的金融稳健性指标
- 三、金融稳定状况指数
- 四、宏观金融风险评分法

第3节 金融稳定性研究的计量经济学模型

- 一、线性模型
- 二、向量自回归模型
- 三、对使用计量方法进行宏观金融风险评价的评价

第4节 基于市场信息的宏观金融风险度量方法

- 一、波动性指标
- 二、结构性方法
- 三、使用市场信息进行金融风险的有效性

第5节 使用资产负债表VaR指标进行部门风险分析

- 一、使用VaR指标研究中央银行的脆弱性
- 二、使用vaR方法研究公共部门风险
- 三、对使用vaR方法进行部门风险分析的基本评价

本章小结

第3章 资产负债表方法的分析基础

第4章 宏观金融风险的资产负债表分析

第5章 宏观金融风险的或有权益分析

第6章 宏观金融风险的指标分析

第7章 宏观金融风险的国际传导研究

第8章 宏观金融风险的国内传导研究

<<宏观金融工程>>

第9章 宏观金融安全指标体系研究

第10章 宏观金融监管体系研究

第11章 宏观金融监管定量分析研究

第12章 宏观金融风险的管理工具和方法

第13章 宏观金融风险与宏观经济资本

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>