

<<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：9787040333534

10位ISBN编号：7040333538

出版时间：2011-9

出版时间：高等教育出版社

作者：叶永刚,宋凌峰,张培

页数：234

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

本书是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。本书延续宏观金融工程理论的基本框架，提出了一个新的宏观风险管理框架——使用宏观经济资本来管理宏观金融风险。

本书首次提出宏观经济资本的概念，从宏观经济资本的度量、配置、绩效考核三大方面出发，全面系统地分析了宏观经济资本在管理宏观风险方面和提高社会资本效率方面的可行性及重要作用。

在定量分析和定性分析的基础上，本书构建了基于宏观、VaR的宏观经济资本管理体系，并针对政府、金融、企业和家户四大部门的实际情况构建出宏观经济风险准备体系，即金融稳定基金。

本书将宏观金融风险管理和经济增长联系起来，为宏观经济发展战略的构建和实施提供了强有力的理论依据和保障机制。

本书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等三个系列、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。

## &lt;&lt;宏观金融工程&gt;&gt;

## 书籍目录

- 第1章 宏观经济资本概论
  - 第1节 宏观金融风险管理与宏观经济资本
    - 一、宏观金融风险及管理的现状研究
    - 二、宏观金融风险管理与宏观金融工程
    - 三、宏观金融工程与宏观经济资本
  - 第2节 宏观经济资本的表现形式
    - 一、金融部门稳定基金
    - 二、企业部门稳定基金
    - 三、公共部门稳定基金
    - 四、家户部门稳定基金
    - 五、稳定基金存在的问题
  - 第3节 本书的研究问题与思路
    - 一、研究问题
    - 二、研究思路
  - 本章小结
- 第2章 宏观经济资本的概念
  - 第1节 文献综述
    - 一、经济资本概念起源
    - 二、经济资本的概念与特征
  - 第2节 微观经济资本的概念与内涵
    - 一、微观经济资本的概念
    - 二、微观经济资本的内涵
  - 第3节 宏观经济资本的内涵与外延
    - 一、宏观经济资本概念的提出
    - 二、宏观经济资本概念及其内涵
    - 三、宏观经济资本的外延
  - 本章小结
- 第3章 宏观经济资本研究的基本框架
  - 第1节 宏观经济资本研究的目标
  - 第2节 宏观经济资本研究的要素
  - 第3节 宏观经济资本研究的总体框架
    - 一、宏观经济资本研究框架
    - 二、宏观经济资本研究路线
  - 本章小结
- 第4章 宏观在险值方法研究
  - 第1节 文献综述
    - 一、VaR方法的发展和改进
    - 二、VaR方法与微观层面风险管理
    - 三、宏观层面VaR研究
  - 第2节 宏观VaR方法研究框架
  - .....
- 第5章 宏观经济资本的度量
- 第6章 宏观经济资本的配置
- 第7章 宏观经济资本与风险管理
- 第8章 金融稳定基金

<<宏观金融工程>>

第9章 金融部门稳定基金

第10章 宏观经济资本与经济增长

第11章 宏观经济资本的绩效评价

## <<宏观金融工程>>

### 媒体关注与评论

“金融是一个复杂的大系统，金融学也是一个复杂的体系。在宽口径的金融学概念下，可以从宏观金融分析和微观金融分析两个层面进行区分。金融工程作为金融学的新兴学科之一，近二十多年来在国际上得到了快速发展，在我国的引进和发展也有十多年。

一般理解，金融工程就是微观金融分析。

而这样一种受到普遍重视的分析方法，是否也能应用于宏观金融方面呢？

对于这个问题，我是在2000年首次从武汉大学叶永刚教授那里得到肯定回答的。

近十年来，叶永刚教授一直从事这个新领域的探索，并已初步形成体系。

目前我国的金融体系正处于快速变革的时期。

宏观工程的研究和建设及其在实践中的运用，必将有利于强化宏观金融风险的管理并更充分地提高金融的效率和作用，其意义不容轻估。

就金融理论创新而言，将金融工程从微观领域拓展到宏观领域，这是极有价值的科研工作。

” ——中国著名金融学家、教育家 黄达

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>