

<<宏观金融工程（上.下册）>>

图书基本信息

书名：<<宏观金融工程（上.下册）>>

13位ISBN编号：9787040352207

10位ISBN编号：7040352206

出版时间：2013-3

出版时间：高等教育出版社

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（上.下册）>>

### 内容概要

《宏观金融工程:区域卷(套装共2册)》在对中国四大部门进行宏观金融风险分析的基础上,分别对东、中、西部地区以及各省(市、自治区)的金融风险进行结构性研究,通过金融工具与手段的创新设计与重新组合来研究和解决我国的宏观金融风险 and 经济发展问题,具有重要的理论和现实意义。

<<宏观金融工程（上.下册）>>

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。

## 书籍目录

第1章中国宏观金融风险研究 第1节引言 第2节中国金融部门风险分析 第3节中国企业部门风险分析 第4节中国公共部门风险分析 第5节中国国家户部门风险分析 第6节结论及政策建议 附录 第2章中国宏观金融风险比较研究 第1节引言 第2节中国东、中、西地区金融风险比较研究 第3节中国省域金融风险比较研究 第4节结论及政策建议 第1篇东部宏观金融风险研究 第3章东部宏观金融风险总论 第1节引言 第2节东部部门资产负债表编制及分析 第3节东部或有权益资产负债表编制及分析 第4节东部宏观金融风险结构分析 第5节结论及政策建议 第4章北京市宏观金融风险研究 第1节引言 第2节北京市部门资产负债表编制及分析 第3节北京市或有权益资产负债表编制及分析 第4节结论及政策建议 第5章天津市宏观金融风险研究 第1节引言 第2节天津市部门资产负债表编制及分析 第3节天津市或有权益资产负债表编制及分析 第4节结论及政策建议 第6章河北省宏观金融风险研究 第1节引言 第2节河北省部门资产负债表编制及分析 第3节河北省或有权益资产负债表编制及分析 第4节结论及政策建议 第7章辽宁省金融风险研究 第1节引言 第2节辽宁省部门资产负债表编制及分析 第3节辽宁省或有权益资产负债表编制及分析 第4节结论及政策建议 第8章上海市宏观金融风险研究 第1节引言 第2节上海市部门资产负债表编制及分析 第3节上海市或有权益资产负债表编制及分析 第4节结论及政策建议 第9章江苏省宏观金融风险研究 第1节引言 第2节江苏省部门资产负债表编制及分析 第3节江苏省或有权益资产负债表编制及分析 第4节结论及政策建议 第10章浙江省金融风险研究 第1节引言 第2节浙江省部门资产负债表编制及分析 第3节浙江省或有权益资产负债表编制及分析 第4节结论及政策建议 第11章福建省宏观金融风险研究 第1节引言 第2节福建省部门资产负债表编制及分析 第3节福建省或有权益资产负债表编制及分析 第4节结论及政策建议 第12章山东省宏观金融风险研究 第1节引言 第2节山东省部门资产负债表编制及其分析 第3节山东省或有权益资产负债表编制及分析 第4节结论及政策建议 第13章广东省宏观金融风险研究 第1节引言 第2节广东省部门资产负债表编制及分析 第3节广东省或有权益资产负债表编制及分析 第4节结论及政策建议 第14章广西壮族自治区宏观金融风险研究 第1节引言 第2节广西部门资产负债表编制及分析 第3节广西或有权益资产负债表编制及分析 第4节结论及政策建议 第15章海南省宏观金融风险研究 第1节引言 第2节海南省部门资产负债表编制及分析 第3节海南省或有权益资产负债表编制及分析 第4节结论及政策建议 第2篇中部宏观金融风险研究 第16章中部宏观金融风险总论 第1节引言 第2节中部部门资产负债表编制及分析 第3节中部或有权益资产负债表编制及分析 第4节中部宏观金融风险结构性分析 第5节结论及政策建议 第17章内蒙古自治区宏观金融风险研究 第1节引言 第2节内蒙古自治区部门资产负债表编制及其分析 第3节内蒙古自治区或有权益资产负债表编制及分析 第4节结论及政策建议 第18章吉林省宏观金融风险研究 第1节引言 第2节吉林省部门资产负债表编制及分析 第3节吉林省或有权益资产负债表编制及分析 第4节结论及政策建议 第19章湖南省宏观金融风险研究 第1节引言 第2节湖南省部门资产负债表编制及分析 第3节湖南省或有权益资产负债表的编制及其分析 第4节结论及政策建议 第20章安徽省宏观金融风险研究 第1节引言 第2节安徽省部门资产负债表编制及分析 第3节安徽省或有权益资产负债表编制及分析 第4节结论及政策建议 第21章江西省宏观金融风险研究 第1节引言 第2节江西省部门资产负债表编制及分析 第3节江西省或有权益资产负债表编制及分析 第4节结论及政策建议 第22章河南省宏观金融风险研究 第1节引言 第2节河南省部门资产负债表编制及分析 第3节河南省或有权益资产负债表编制及分析 第4节结论及政策建议 第23章湖北省宏观金融风险研究 第1节引言 第2节湖北省部门资产负债表编制及分析 第3节湖北省或有权益资产负债表编制及分析 第4节结论及政策建议 第24章黑龙江省宏观金融风险研究 第1节引言 第2节黑龙江省部门资产负债表编制及分析 第3节黑龙江省或有权益资产负债表编制及分析 第4节结论及政策建议 第25章山西省宏观金融风险研究 第1节引言 第2节山西省部门资产负债表编制及分析 第3节山西省或有权益资产负债表编制及分析 第4节结论及政策建议 第3篇西部宏观金融风险研究 第26章西部宏观金融风险总论 第1节引言 第2节西部部门资产负债表编制及分析 第3节西部或有权益资产负债表编制及分析 第4节西部宏观金融风险结构性分析 第5节结论及政策建议 第27章重庆市宏观金融风险研究 第1节引言 第2节重庆市部门资产负债表编制及分析 第3节重庆市或有权益资产负债表编制及分析 第4节结论及政策建议 第28章四川省宏观金融风险研究 第1节引言 第2节四川省部门资产负债表编制及分析 第3节四川省或有权益资产负债表编制及分析 第4节结论及政策建议 第29章贵州省宏观金融风险研究 第1节引言 第2节贵州省部门资产负债表

编制及分析 第3节贵州省或有权益资产负债表编制及分析 第4节结论及政策建议 第30章云南省宏观金融风险研究 第1节引言 第2节云南省部门资产负债表编制及分析 第3节云南省或有权益资产负债表编制及分析 第4节结论及政策建议 第31章西藏自治区宏观金融风险研究 第1节引言 第2节西藏自治区部门资产负债表编制及分析 第3节西藏自治区或有权益资产负债表及分析 第4节结论及政策建议 第32章陕西省宏观金融风险研究 第1节引言 第2节陕西省部门资产负债表编制及分析 第3节陕西省或有权益资产负债表编制及分析 第4节结论及政策建议 第33章甘肃省宏观金融风险研究 第1节引言 第2节甘肃省部门资产负债表编制及分析 第3节甘肃省或有权益资产负债表编制及分析 第4节结论及政策建议 第34章宁夏回族自治区宏观金融风险研究 第1节引言 第2节宁夏部门资产负债表编制及分析 第3节宁夏或有权益资产负债表编制及分析 第4节结论及政策建议 第35章青海省宏观金融风险研究 第1节引言 第2节青海省部门资产负债表编制及分析 第3节青海省或有权益资产负债表编制及分析 第4节结论及政策建议 第36章新疆维吾尔自治区宏观金融风险研究 第1节引言 第2节新疆部门资产负债表编制及分析 第3节新疆或有权益资产负债表编制及分析 第4节结论及政策建议 第4篇港澳台地区宏观金融风险研究 第37章香港宏观金融风险研究 第1节引言 第2节文献综述 第3节香港部门资产负债表编制及分析 第4节香港或有权益资产负债表编制及分析 第5节结论及政策建议 第38章澳门宏观金融风险研究 第1节引言 第2节澳门部门资产负债表编制及分析 第3节澳门或有权益资产负债表编制及分析 第4节结论及政策建议 第39章台湾宏观金融风险研究 第1节引言 第2节台湾部门资产负债表编制及分析 第3节台湾或有权益资产负债表编制及分析 第4节结论及政策建议 参考文献

## 章节摘录

版权页：插图：（二）中国企业部门风险小结 相比金融部门，企业部门的风险敞口更大，是承受宏观风险的主体。

但本文认为虽然遭受了自美国次贷危机以来等一系列的冲击，企业整体的资产负债率比较合理，总体上盈利能力较强，风险尚在可控范围之内，保持了较好的发展态势。

基于选取的上市1600多家企业季度数据，上市企业部门的账面指标，如资产负债率、产权比率均呈现逐年上升的趋势，反映了当前上市企业普遍面临的风险状况。

或有资产负债表反映的趋势和历史资本市场的变化趋势趋同，资产市值和权益市值的最高点出现在2007年之后，受国际金融危机的影响，市场和价格等经济因素急剧变化，外需下滑、内需不振的双重打击使得企业部门经济运行的压力增大，企业部门资产总值回落，增幅下降。

以5000家企业为代表对全国整体企业部门进行风险研究。

从账面资产负债表和或有权益资产负债表看，反映出与上市企业部门类似的趋势。

但显然，企业整体（上市与非上市企业）的资产和权益市值更接近于账面水平，定价更为合理。

而上市企业部门受到直接的市场冲击和价格波动，市值大幅偏离账面价值，但市值的不稳定性也使得以市场公允价值计量的企业风险的可信度降低。

在风险指标的分析中，企业部门的情形不是十分乐观。

资产市值波动率变动趋势不稳定，违约距离在波动中趋于下降。

企业部门压力测试结果显示部门的资产市值对利率巨大变化的抗压力是很强的，敏感度很低，说明目前中国企业部门应对利率风险的能力较强。

中国公共部门（包括央行）和家户部门面临的风险较小，中国公共部门目前在货币错配和资本结构方面不存在明显的漏洞，有相当充足的外汇储备来抵御来自国际投机资本的冲击，但要注意防范部门间的风险传导。

整体看，中国经济体是比较稳固和健康的。

中国面对美国次贷危机导致的金融危机采取了比较有效的措施，外汇储备充足，外债结构和数量合理，在外汇管理能力上也有了长足的进步，有效地促使了中国经济在危机中持续健康的发展。

<<宏观金融工程（上.下册）>>

编辑推荐

《宏观金融工程:区域卷(套装共2册)》由高等教育出版社出版。

<<宏观金融工程（上.下册）>>

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>