

<<宏观审慎管理>>

图书基本信息

书名：<<宏观审慎管理>>

13位ISBN编号：9787509735695

10位ISBN编号：7509735696

出版时间：2012-8

出版时间：社会科学文献出版社

作者：刘仁伍 编著

页数：331

字数：319000

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>

## <<宏观审慎管理>>

### 内容概要

本书从中国经济金融发展现状和分业监管体制出发，分析研究中国系统性金融风险的根源和形成机制，探索构建中国宏观审慎管理的制度框架，设计适合中国的宏观审慎管理政策体系。

<<宏观审慎管理>>

作者简介

刘仁伍

男，1955年生于吉林。

经济学博士。

享受国务院特殊津贴的专家。

现任中国人民银行海口中心支行行长、国家外汇管理局海南省分局局长，中国对外经济贸易大学等多所大学兼职教授。

主要研究领域为货币政策与宏观调控、金融风险防范与处置，以及农村金融。

目前，已经出版《新农村建设中的金融问题》、《金融稳定：机理与评价》、《东南亚经济运行报告(2006)》、《金融监管前沿问题》，以及《区域金融结构研究》等著作7部；在《金融研究》、《中国金融》，以及《银行家》等学术期刊上发表《结构失衡下的宏观调控》、《反外贸失衡的金融政策》等论文数十篇。

## &lt;&lt;宏观审慎管理&gt;&gt;

## 书籍目录

## 第一章 导论

- 第一节 问题提出
- 第二节 宏观审慎管理的概念界定
- 第三节 宏观审慎管理研究综述
- 第四节 结构安排与内容创新

## 第二章 从巴塞尔协议 至 看国际金融监管的发展与趋势

- 第一节 巴塞尔协议的历史背景及发展进程
- 第二节 巴塞尔协议监管内容的细化与深化
- 第三节 巴塞尔协议监管理念的演变及评价
- 第四节 国际金融监管发展的趋势和展望

## 第三章 我国系统性金融风险测度与宏观压力测试研究

- 第一节 系统性金融风险的定义、基本特征和演化过程
- 第二节 我国系统性金融风险生成的潜在因素
- 第三节 系统性金融风险的测度方法
- 第四节 我国系统性金融风险测度的实证研究

## 第四章 时间维度宏观审慎管理：逆周期调控机制构建

- 第一节 金融摩擦与货币政策
- 第二节 逆周期宏观审慎管理工具及建模方法
- 第三节 开放经济下含有金融加速器的DSGE模型构建
- 第四节 模型参数估计与脉冲响应函数模拟
- 第五节 结论及政策含义

## 第五章 空间维度宏观审慎管理：集中度风险控制机制构建

- 第一节 国际金融危机的教训
- 第二节 我国房地产贷款风险特点和风险外溢效应的实证分析
- 第三节 我国地方融资平台风险状况和潜在传导机制分析
- 第四节 我国跨行业宏观审慎管理的政策建议

## 第六章 我国宏观审慎管理组织框架构建研究

- 第一节 我国金融监管体制的历史、现状及弊端
- 第二节 国际上宏观审慎管理框架构建
- 第三节 我国宏观审慎管理组织框架构建的建设想

## 第七章 我国宏观审慎管理工具体系研究

- 第一节 宏观审慎管理政策工具设计与使用原则
- 第二节 国际宏观审慎管理政策工具发展的主要特点
- 第三节 宏观审慎管理政策工具的分类
- 第四节 中国宏观审慎管理政策工具的实证分析
- 第五节 政策建议与启示

## 第八章 我国宏观审慎管理法律体系构建研究

- 第一节 立法确立宏观审慎管理的职责分工
- 第二节 健全金融危机救助的法律制度
- 第三节 完善金融消费者保护的法律体系
- 第四节 完善我国金融市场的监管立法
- 第五节 本章小结

## 章节摘录

第三章是“我国系统性金融风险测度与宏观压力测试研究”。

本章首先给出了系统性金融风险的定义、特点和演变过程，并从时间维度和空间维度出发，对系统性风险进行了深入的剖析。

其次，我们讨论了系统性风险的一般成因，在此基础上，结合我国的实际情况，定性分析了我国系统性金融风险生成的潜在因素。

最后，我们采用宏观压力测试模型，对我国系统性金融风险的现状和未来趋势进行实证分析。

在定性和定量分析的基础上，我们认为当前我国爆发系统性金融风险的可能性不大，但金融体系整体风险状况在不断恶化，防范系统性风险刻不容缓。

从冲击模拟的结果看，在时间维度上，我们需要关注以热钱为代表的跨境资金的顺周期流动；在空间维度上，我们需要警惕因房价下跌引发的系统性金融风险。

第四章是“时间维度宏观审慎管理：逆周期调控机制构建”。

本章回顾了国外金融摩擦理论和使用宏观审慎政策工具减少顺周期风险累积的方式，梳理了目前将宏观审慎管理政策工具纳入动态随机一般均衡模型（DSGE）的途径。

根据第三章的主要结论，我们将跨境资金流动纳入货币政策的分析框架，构建我国开放经济条件下由家庭、企业、银行、中央银行和零售商五部门组成的DSGE模型。

将银行的资本资产比、银行对家庭信贷的抵押物价值贷款比、银行对企业信贷的抵押物价值贷款比引入模型，用Matlab模拟了技术增长率、国际收支顺差、银行资本资产比要求、银行对家庭信贷的抵押物价值贷款比要求、银行对企业信贷的抵押物价值贷款比要求五种随机冲击，以及中央银行提高法定存款准备金率、法定存款利率上限两种确定性冲击对宏观经济波动的影响，分析了货币政策与宏观审慎管理工具的协调配合机制。

.....

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>