

图书基本信息

书名：<<衍生金融工具交易与系统性金融风险>>

13位ISBN编号：9787516110430

10位ISBN编号：7516110434

出版时间：2012-6

出版时间：中国社会科学出版社

作者：陈金荣

页数：384

字数：430000

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>

<<衍生金融工具交易与系统性金融风险>>

内容概要

陈金荣编著的《衍生金融工具交易与系统性金融风险——形成传导与监管》主要运用金融学相关理论和统计方法就衍生金融工具交易对系统性金融风险的形成、传导机制及监管问题进行了系统研究。

本书第一、第二章首先提出了研究背景、整体框架、主要观点、研究方法以及创新点，界定了衍生金融工具及系统性风险，整理了有关衍生金融工具交易与系统性金融风险的研究文献。

第三、四、五、六章是本书重点章节，分别从衍生金融工具产品特性、交易所组织形式、市场参与主体以及宏观经济因素等角度，分析衍生金融工具交易对系统性金融风险的冲击及传递方式，特别是在第六章通过对中国金融衍生市场相关问题的实证分析，指出随着中国金融市场进一步融合世界经济过程中，衍生品市场引致系统性风险的可能性增加。

在国内宏观经济形势复杂、外部冲击频繁及市场开放进程加快的背景下，要有效地避免衍生金融工具传染并形成系统性金融风险，需确保宏观经济持续稳步发展，有效地平衡市场开放所带来的制度性冲击。

《衍生金融工具交易与系统性金融风险——形成传导与监管》第七章将理论研究引向现实问题，重点厘清了相关监管的基本原则，借鉴国际经验，针对性地提出监管建议。

作者简介

陈金荣，男，广西桂林人，1973年8月出生，现供职于国内某大型金融机构，主要从事资本市场相关实务工作。

2008年毕业于中国社科院研究生院政府政策与公共管理系，获经济学博士学位（国民经济学专业），主要研究方向为中国金融改革与风险防范。

在《上海金融》、《煤炭经济研究》等刊物发表多篇学术文章，有译著（与人合译）在机械工业出版社出版。

书籍目录

第一章 导论

第一节 研究背景

第二节 研究思路及研究方法

一 研究思路

二 研究方法及创新点

第三节 结构安排

第二章 概述

第一节 衍生金融工具和市场概况

一 金融衍生产品简介

二 全球衍生金融工具市场概况

三 与衍生工具市场有关的问题

第二节 衍生金融工具的风险

一 风险分类

二 新巴塞尔协议和风险测算

三 重大亏损案例统计

第三节 系统性金融风险

一 系统金融风险与系统性金融风险的表现形式

二 系统性金融风险的表现形式

三 与衍生金融工具交易有关的金融危机统计

四 案例分析

第四节 文献综述

一 系统性风险和金融危机

二 衍生工具交易和系统性风险

三 对现有文献的总体评价

第三章 产品特性及交易形式分析：衍生金融工具交易与系统性金融风险的形成

第一节 衍生金融工具的产品特性

一 高杠杆性对金融系统性风险的冲击

二 流动性风险对系统性金融风险的形成

三 虚拟性与金融系统的不稳定性

第二节 衍生金融工具交易的组织形式对系统性金融风险的冲击与传导分析

一 交易所市场有助于降低系统性金融风险

二 场外交易市场传导系统性金融风险的机制

第三节 本章小结

第四章 市场交易主体分析：衍生金融工具交易对系统性金融风险的传递

第一节 银行衍生品交易与系统性金融风险

一 银行交易衍生金融工具的目的

二 银行交易衍生金融工具的特点

三 银行的风险聚集与系统性金融风险的形成

四 案例分析——银行交易衍生金融产品与次贷危机

第二节 商业银行系统性风险的模型与计量分析

一 巴塞尔协议框架下的商业银行风险计量

二 中国商业银行的系统性风险

第三节 对冲基金形成、传递系统性金融风险

一 对冲基金概论

二 对冲基金交易衍生金融工具的特点

<<衍生金融工具交易与系统性金融风险>>

三 对冲基金冲击与传导系统性金融风险

四 案例分析：对冲基金在系统性金融风险的作用

第四节 对冲基金系统性风险的计量

第五节 本章小结

第五章 宏观经济因素分析：衍生金融工具交易产生系统性风险的作用环境

第一节 金融危机的宏观条件金融衍生工具交易与系统性风险

一 金融危机的宏观条件及其特征

二 衍生金融工具与国际资本流动

三 衍生金融工具交易、金融创新与实体经济

四 中国的金融危机宏观条件

第二节 宏观经济政策、金融衍生工具交易与系统性风险

一 金融自由化政策、金融衍生工具交易与系统性风险

二 稳健的货币财政政策、金融衍生工具交易与系统性风险

三 有效金融监管、金融衍生工具交易与系统性风险

第三节 案例分析

一 墨西哥比索危机原因剖析

二 泰国金融危机原因剖析

三 阿根廷金融危机原因剖析

第四节 金融稳定性指标体系与预警模型

一 国际货币基金组织：金融系统健康状况的审慎宏观指标体系

二 Kamiky and Reinhart(1999)的危机预警模型

三 其他危机预警模型

四 中国危机预警与系统性金融风险

第六章 衍生工具交易与系统性风险的中国实证分析

第一节 中国衍生工具市场发展的现状

一 中国衍生工具市场概况

二 中国金融衍生品交易的风险

第二节 衍生工具交易与中国资本市场波动性的实证分析

一 股指期货与股票市场波动性分析

二 权证对基础证券影响的研究分析

三 人民币无本金交割远期外汇市场引起系统性风险的实证研究

第三节 中国宏观经济脆弱性与系统性金融风险分析

一 宏观经济整体健康与局部风险聚集

二 资本账户逐步开放与国际金融传染的效应增大

三 银行主导型的金融结构与场外衍生市场的风险集中

四 我国金融市场机制的不完善与衍生金融交易的风险

五 结论：我国衍生金融产品交易与系统性金融风险的可能性

第四节 本章小结

第七章 衍生金融工具的监管

第一节 衍生金融工具及市场监管的基本原则

一 系统性原则

二 注重自律与市场约束的原则

三 监管效率性原则

四 金融救助原则

第二节 衍生金融市场政府监管体系的比较

一 美国多个监管机构共存模式

二 英国的统一监管模式

- 三 德国的监管体系
- 四 澳大利亚的不完全统一监管模式
- 五 新兴经济体的监管模式
- 六 各监管模式的比较评价
- 第三节 衍生金融市场自律监管的比较
 - 一 自律监管与政府监管的关系
 - 二 衍生金融市场行业协会自律组织——以期货行业协会为例
 - 三 衍生金融品交易所的自律监管
- 第四节 衍生金融市场的国际监管
 - 一 巴塞尔委员会
 - 二 国际证监会组织
 - 三 国际清算银行和WTO框架下的衍生金融监管
- 第五节 衍生金融市场监管的国际经验借鉴
 - 一 场外衍生交易监管的国际经验
 - 二 信用衍生产品监管的国际经验
 - 三 对冲基金的国际监管重点
 - 四 “次贷危机”的经验与教训
- 第六节 衍生金融品交易的信息披露要求
 - 一 从安然事件看改进信息披露的必要性
 - 二 衍生金融工具风险信息披露的目的和基本要求
 - 三 衍生金融工具风险信息定性披露的具体内容
 - 四 衍生金融工具风险信息定量披露的具体内容
- 第七节 中国衍生金融市场发展与监管
 - 一 中国衍生金融产品的发展历程
 - 二 中国衍生金融产品及市场的监管
- 第八节 本章小结
- 参考文献
 - 一 英文参考文献
 - 二 中文参考文献
 - 三 相关网站
 - 四 数据库
- 后记

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>