

<<宏观金融风险形成的微观机理研究>>

图书基本信息

书名：<<宏观金融风险形成的微观机理研究>>

13位ISBN编号：9787505868168

10位ISBN编号：7505868160

出版时间：2007-12

出版时间：经济科学出版社

作者：张屹山

页数：437

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>

## <<宏观金融风险形成的微观机理研究>>

### 内容概要

宏观金融风险，亦称国家金融风险，是指一个国家范围内的系统性金融风险。

宏观金融风险归根结底是由微观市场主体的行为互动和累积而造成的，研究宏观金融风险形成的微观机理，不仅可以从理论上找到其来源的关键点，而且可以在实践上为制定合理的政策提供坚实的基础。

基于此，本书着重研究宏观金融风险来源的内部原因和外部原因。

内部原因主要包括货币市场风险、资本市场风险。

本书最后综合考虑了整个经济系统，应用基于主体的模拟方法，从微观个体出发模拟宏观金融体制，分析货币政策和关税政策的分配效应、传导效应和累计效应。

## 作者简介

张屹山，男，1949年10月生。  
1970年入吉林大学数学系学习。  
1973年毕业留校任教，1992-1993年在日本关西学院大学学习。  
现为吉林大学商学院院长、教授、博士生导师，中国数量经济学会理事长，吉林省决策咨询专家。  
自1980年起，从事数量经济的教学和科研工作，是我国最早从事这方面工作的学者之一。  
在经济管理类教学中实现文理渗透，定性与定量分析相结合，理论联系实际等方面做出了突出贡献。

在经济数量分析、资本运营和企业经济理论方面取得了丰富成果。  
出版学术著作15部，其中《投入产生技术研究》一书获国家教委首届人文社会科学优秀科研成果二等奖等。

书籍目录

第1章 绪论 1.1 本书研究的理论价值和现实意义 1.2 本书研究的国内外现状及其评述 1.3 本书研究的主要内容、思路和方法第2章 货币市场风险形成机理 2.1 银行资本结构与不良债权问题研究 2.2 不完全信息条件下的金融中介理论 2.3 银行挤兑风险模型与金融风险 2.4 信贷风险与景气波动第3章 资本市场风险形成机理 3.1 资产价格泡沫研究 3.2 资本市场泡沫形成的内在机理 3.3 资本市场风险度量的贝塔系数方法第4章 外汇市场风险形成机理 4.1 汇率体制与汇率选择模型 4.2 外债结构对金融危机的影响 4.3 货币危机理论研究 4.4 外汇风险预警研究第5章 金融风险的交互作用与微观机理 5.1 货币市场、资本市场和外汇市场之间的互动关系 5.2 金融风险的传染模型 5.3 经济系统稳定性与金融风险形成过程的综合模型 5.4 非对称信息与金融风险形成的微观机制分析第6章 我国经济转轨过程中的金融风险形成 6.1 我国景气波动和信贷风险相关性的实证分析 6.2 我国开放式基金泡沫的实证分析 6.3 我国沪深股市风险的vaR模型分析 6.4 我国外汇风险预警指数的估计及其主要影响因素分析第7章 微观模拟模型与金融市场分析 7.1 微观模拟模型 7.2 通货膨胀微观模拟模型 7.3 货币替代微观模拟模型 7.4 汇率波动微观模拟模型参考文献后记

章节摘录

第1章 绪论 金融是现代经济的核心，防范和化解金融风险是保持国民经济快速、协调和可持续发展的必要条件之一。

要防范金融风险，就必须对金融风险形成的机理作深入的分析研究。

本书就是从微观的角度介入，借助于数理模型、计量方法和智能模拟工具对宏观金融风险形成的机理作深入的探讨。

1.1 本书研究的理论价值和现实意义 自纸币出现之后，经济系统就开始由虚拟经济与实体经济两部分组成了。

所谓虚拟经济，是指以金融资产为主要交易对象的交易活动。

它具有三大特征：一是独立运行性。

尽管虚拟经济的运行最终脱离不了实体经济的基础，但随着金融市场的不断发展，交易时间与交易规模的限制被不断突破，它受实体经济的制约也越来越弱，在一定程度上形成自我运行的独立系统。

二是自我繁衍性。

在金融市场上，金融工具，特别是现代衍生金融工具，其生产成本几乎为零，从而其供给可以是无限的。

主要表现为，金融工具的创新，不仅其本身丰富了交易工具的内容，更重要的是，新的交易工具本身又能克隆出新的金融工具，从而导致虚拟经济的发展在数量、速度上都远远超过实体经济，使现代经济结构成为一个以实体经济为基础倒金字塔形。

三是不稳定性。

人们对金融产品的需求基本只受个人信心和对未来预期的支配，具有极强的不稳定性。

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>