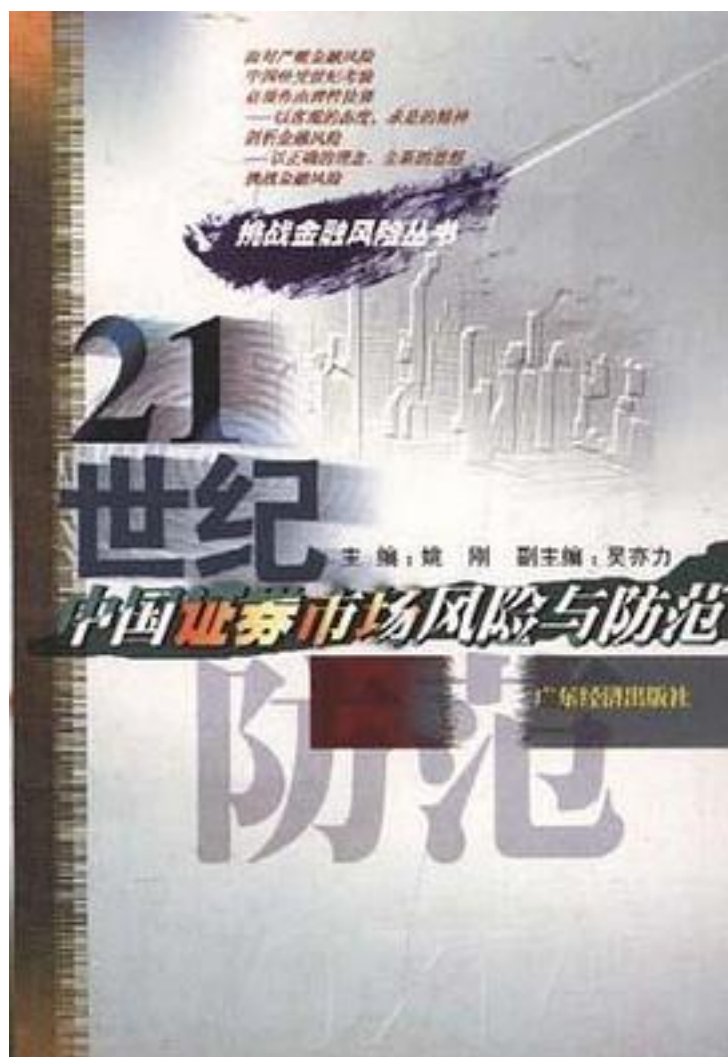


21世纪中国证券市场风险与防范



[21世纪中国证券市场风险与防范_下载链接1](#)

著者:

出版者:广东经济出版社

出版时间:2000-01

装帧:平装

isbn:9787806325919

作者介绍:

目录: 目 录

前 言 千年更替、世纪之交的中国证券市场:

功能与风险

第一章 证券市场风险的特性与分类

第一节 证券市场风险的定义与特性

一 风险与证券市场风险

二 证券市场风险的来源

三 证券市场风险的特征

第二节 证券市场风险的分类

一 按风险承受者划分

二 按风险来源划分

三 按交易过程划分

四 按风险与收益的关系划分

第二章 证券市场风险的形成、传导与防范

第一节 证券市场风险的成因

一 证券市场自身的不稳定性导致的风险

二 外部因素冲击导致的风险

第二节 证券市场风险的传导机制

一 国内不同市场间的风险传导机制

二 国际证券市场间的风险传导机制

第三章 证券市场风险的计量方法

第一节 证券投资风险的计量方法

一 用价差率来衡量风险

二 灵敏度分析与 β 系数法

三 波动分析法 (方差或标准差法)

四 用低位部分矩LPMs来计量风险

第二节 证券风险量化管理的VAR法

一 VAR法产生的背景

二 VAR的计算原理

三 VAR方法的应用

四 VAR方法的补充——应力测试与场景分析

第四章 21世纪中国证券市场的风险环境和

主要风险

第一节 市场制度的转轨及其风险

一 市场的统一带来的风险

二 市场的开放带来的风险

第二节 市场参与者体制的不健全及其风险

一 证券商

二 投资者

三 上市公司

第三节 证券市场发展带来的风险

一 衍生工具的风险

二 证券市场的国际化和国际金融风险的冲击

三 高技术化和INTERNET应用带来的风险

第五章 证券市场系统风险的监测与防范

第一节 监测系统风险的指标体系

一 关于证券市场内在稳定性指标

二 关于国内金融体系稳定性指标

三 关于汇率、外债和国际资本流动指标

第二节 系统风险的综合评估与预警模型

- 一 单因素变量的安全值域
- 二 系统风险的综合评估模型
- 三 系统风险的监测预警模型
- 第三节 中国证券市场系统风险的实证评估
- 一 中国证券市场内在稳定性的历史表现
- 二 国内金融体系风险
- 三 外债和国际资本流动风险
- 第四节 中国证券市场系统风险的防范措施
- 一 加强对证券市场直接的动态监测和管理
- 二 国内宏观金融经济运行的稳健性
- 三 加强外债和国际流动资本管理
- 第五节 21世纪证券市场系统风险监测与防范的新内容
- 一 开放条件下系统风险的新内容
- 二 金融衍生工具的发展及其影响
- 三 证券银行综合化经营趋势及其影响
- 四 监管的发展方向
- 第六章 证券市场参与机构的风险控制
- 第一节 证券商的风险控制
- 一 风险识别
- 二 风险控制的策略和技术
- 三 风险控制的组织和程序
- 第二节 证券投资基金的风险控制
- 一 风险识别
- 二 风险控制的策略和技术
- 三 风险控制的组织和程序
- 第三节 上市公司的风险控制
- 一 风险识别
- 二 风险控制
- 第七章 妥善解决国有股和法人股上市流通问题
- 第一节 国有股和法人股上市流通的必要性
- 第二节 国有股和法人股上市流通的难点和原则
- 一 国有股和法人股上市流通的难点分析
- 二 解决国有股和法人股上市流通问题的几个原则
- 第三节 国有股和法人股五种上市流通方案比较分析
- 一 置换优先股
- 二 发行可交换债券
- 三 设立C股市场
- 四 预先公告上市时间表
- 五 缩股上市
- 第四节 国有股和法人股上市流通的可行性方案
- 一 上市前的必要准备
- 二 四种可选择的上市方式
- 三 上市所要求的制度配套
- 第八章 平稳实现我国证券市场的国际化
- 第一节 中国证券市场国际化的必要性和必然性
- 一 中国证券市场国际化的必要性分析
- 二 中国证券市场国际化的客观必然性
- 第二节 资本市场开放的国际经验
- 第三节 证券市场开放过程中的一般问题
- 一 证券市场开放的条件

- 二 开放之中的监管和控制
- 第四节 中国证券市场国际化战略
 - 一 证券市场国际化的准备阶段
 - 二 初步开放阶段
 - 三 基本开放阶段
 - 四 完全开放阶段
- 第九章 国际金融监管体系：框架、缺陷和重构
 - 第一节 国际金融监管体系的组织构架：三驾马车
 - 一 对国际金融体系的宏观监控
 - 二 对银行体系的国际监管
 - 三 对证券市场的国际监管
 - 第二节 国际金融监管的核心内容：原则、目标 and 手段
 - 一 国际货币基金组织关于稳定各国金融体系的七个原则
 - 二 巴塞尔委员会关于银行体系国际监管的系列纲领性文件涵盖了银行监管的主要原则、目标和手段
 - 三 证监会国际组织关于证券市场监管的原则、目标与建议
 - 第三节 金融监管组织之间的国际合作和协调
 - 一 双边合作
 - 二 三边合作
 - 三 四边合作
 - 四 多边合作
 - 第四节 国际金融监管体系面临的挑战
 - 一 对国际资本流动的监管
 - 二 反金融危机机制
 - 三 对对冲基金的监管
 - 第五节 改革和完善国际金融监管体系
 - 一 改革国际金融体系的设想
 - 二 完善国际金融监管体系的措施
 - 三 中国在完善国际金融监管体系中应发挥的作用
 - 参考文献
 - • • • • (收起)

[21世纪中国证券市场风险与防范_下载链接1](#)

标签

证券

评论

[21世纪中国证券市场风险与防范_下载链接1](#)

书评

[21世纪中国证券市场风险与防范_下载链接1](#)