

# 《银行资本监管研究》

## 图书基本信息

书名：《银行资本监管研究》

13位ISBN编号：9787509603307

10位ISBN编号：7509603307

出版时间：2009-3

出版社：经济管理出版社

页数：163

版权说明：本站所提供下载的PDF图书仅提供预览和简介以及在线试读，请支持正版图书。

更多资源请访问：[www.tushu000.com](http://www.tushu000.com)

# 《银行资本监管研究》

## 内容概要

《银行资本监管研究》对金融混业集团主导下的银行资本监管进行了研究：从实物资本积累和资产净值、银行的最优行为以及考虑资本充足率要求三个方面构建了金融混业集团主导下银行的资本监管理论模型，建立了资本充足率要求的单期和多期监管模型，拓展了Holmstrom and Tirole模型；构建了动态博弈模型，研究了监管部门与金融混业集团主导下银行等局中人之间的博弈关系；利用计量经济学和面板数据对我国现阶段金融混业集团主导下的银行资本监管与风险进行了实证研究。

# 《银行资本监管研究》

## 作者简介

刘夏，1972年生，重庆市人，副教授。2002年毕业于重庆大学经济与工商管理学院工商管理专业，获工商管理硕士学位；2008年毕业于重庆大学经济与工商管理学院技术经济及管理专业，获管理学博士学位。长期从事金融经济研究，在各级学术刊物上发表论文20余篇，主要研究方向为金融经济。

蒲勇健，1961年生，经济学博士、教授、博士生导师、国务院特殊津贴专家、中国百名科技创新优秀青年奖获得者、重庆市首届科技创新十大杰出青年、国家教育部高校人文社科优秀青年教师奖获得者、跨世纪青年学术骨干等。

## 书籍目录

### 第一章 绪论

#### 第一节 选题的背景与意义

#### 第二节 金融混业集团及有关核心概念的界定

##### 一、金融混业集团的界定

##### 二、金融监管的界定

##### 三、资本充足率的界定

##### 四、银行资本的界定

##### 五、金融监管模式的界定

##### 六、巴塞尔资本协议

#### 第三节 研究思路、研究内容和研究方法

##### 一、研究思路

##### 二、研究内容

##### 三、研究方法

#### 第四节 创新之处

### 第二章 基于经济学背景的金融监管理论评述

#### 第一节 基于经济学背景的金融监管理论评述

##### 一、金融监管的产生

##### 二、金融监管的目的

##### 三、存款保险制度

##### 四、资本充足率监管

##### 五、公司治理、内部控制

##### 六、市场力量约束

##### 七、新巴塞尔协议与资本监管

##### 八、金融监管与金融创新

#### 第二节 金融监管理论的演变

##### 一、20世纪30年代以前：金融监管理论的萌芽

##### 二、20世纪30-70年代：严格监管、安全优先

##### 三、20世纪70-80年代末：金融自由化、效率优先

##### 四、20世纪90年代以来：安全与效率并重的金融监管理论

##### 五、《巴塞尔协议》反映监管思想的根本转变

#### 本章小结

### 第三章 从分业经营到混业经营：国际经验

#### 第一节 美国金融业从分业到混业

##### 一、美国金融业分业经营的产生

##### 二、美国金融业向混业经营发展

##### 三、商业银行从事证券业务的具体模式

##### 四、美国金融监管体制改革

#### 第二节 德国金融业从分业到混业：全能银行

##### 一、全能银行体制

##### 二、德国全能银行模式的评价

##### 三、德国全能银行的监管模式

#### 第三节 英国金融业从分业到混业

##### 一、英国金融业分工格局的演变轨迹

##### 二、英国银行业监管体系

#### 第四节 日本金融业从分业到混业

##### 一、日本金融控股公司的历史演变

##### 二、日本金融业从分业到混业的主要原因

- 三、日本金融控股公司的几种类型
- 四、日本金融业监管
- 第五节 中国金融业的分工演进
  - 一、中国金融业从混业到分业的演变轨迹
  - 二、愈演愈烈的“交叉经营”
  - 三、金融控股公司的实践
- 本章小结
- 第四章 金融混业集团均衡与资本监管
  - 第一节 金融混业集团均衡
  - 第二节 霍姆斯特龙和泰勒尔模型拓展
    - 一、模型
    - 二、均衡
    - 三、稳定状态和转换
  - 四、经济影响和资本充足率监管影响
  - 第三节 资本充足率要求的单期和多期监管模型
    - 一、金融混业集团的资本供给
    - 二、多期模型
- 本章小结
- 第五章 资本监管与激励机制
  - 第一节 资本监管与激励机制模型假设
  - 第二节 资本监管约束
    - 一、短期投资组合配置与外部资本
    - 二、中期投资组合分配与内部资本
  - 第三节 监管和激励机制模型构建
    - 一、短期对投资组合配置的影响
    - 二、中期投资组合配置影响
- 本章小结
- 第六章 资本监管、市场约束与风险互动机制
  - 第一节 资本监管与市场约束
    - 一、引言
    - 二、模型构建
    - 三、资本监管的局限
    - 四、市场约束
    - 五、监管约束
  - 第二节 资本监管要求与风险的跨期效应
- 本章小结
- 第七章 资本监管模式研究
  - 第一节 混业经营与金融监管的关系
  - 第二节 监管的最优合约：一个道德风险模型
  - 第三节 分业监管博弈模型
  - 第四节 混业监管重复博弈模型
- 本章小结
- 第八章 资本监管与风险实证研究
  - 第一节 引言
  - 第二节 样本选取和指标确定及数据采集
  - 第三节 研究假设和模型设置
    - 一、研究假设
    - 二、模型设置
  - 第四节 实证分析结果及结论建议

本章小结

第九章 研究结论

一、主要结论

二、政策建议

三、进一步研究建议

参考文献

后记

# 《银行资本监管研究》

## 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:[www.tushu000.com](http://www.tushu000.com)