

金融监管研究

FINANCIAL REGULATION RESEARCH

1

2013年

总第13期

■ 金融脆弱性视角下的两次大危机比较研究

——基于BLISHER框架 / 刘春航

■ 我国国债收益率曲线与宏观经济的先行关系及货币政策传导研究

/ 中国人民银行调查统计司课题组

■ 银行业系统性风险外部环境冲击的量化研究

——基于中国经验数据的测度 / 刘志清 鄢姣 余志勇

目录

金融脆弱性视角下的两次大危机比较研究——基于BLISHER框架 /刘春航	1
我国国债收益率曲线与宏观经济的先行关系及货币政策传导研究 /中国人民银行调查统计司课题组	27
银行业系统性风险外部环境冲击的量化研究——基于中国经验数据的测度 /刘志清 鄢姣 余志勇	45
Vasicek方向久期：一类新的利率风险免疫工具 /朱峰	69
关系型信贷与中小企业融资绩效 /颜白鹭	80
基于因子分析的中国商业银行经营绩效评价研究——来自2010—2011年上市银行的 经验证据 /顾海峰 李丹	93

CONTENTS

A Comparative Analysis of the Two Major Crises from the Perspective of Financial Fragility——Based on the BLISHER Framework

/LIU Chunhang 1

Government Bond Yield Curve as an Indicator of the Macro Economy and Monetary Policy in China

/The Task Force in the Survey and Statistics Department, The People's Bank of China 27

A Quantitive Study of the External Impact on the Systemic Risk of the Banking Sector——Based on China's Empirical Data

/LIU Zhiqing, YAN Jiao, YU Zhiyong 45

Vasicek Directional Duration: A New Tool for Interest Rate Risk Immunization

/ZHU Feng 69

Relationship Lending and Financing Efficiency of SMEs

/YAN Bailu 80

Performance Evaluation of China's Commercial Banks Based on Factor Analysis

——Empirical Evidence of 2010-2011 Listed Banks

/GU Haifeng, LI Dan 93