

<<社会保障基金资产配置策略研究>>

图书基本信息

书名：<<社会保障基金资产配置策略研究>>

13位ISBN编号：9787030329448

10位ISBN编号：7030329449

出版时间：2012-1

出版时间：科学出版社

作者：刘海龙 等著

页数：322

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>

## <<社会保障基金资产配置策略研究>>

### 内容概要

本书共分3部分11章，第1部分基础篇包括第1章至第3章，主要介绍社会保障制度、社保基金制度和社保基金投资运作监管模式，中国养老保险制度模型及社保基金资产配置策略的研究现状；第2部分理论篇包括第4章至第8章，主要研究基于收益保证的资产配置策略，基于习惯形成的资产配置策略，基于下边风险测度的资产配置策略，收益保证成本估算模型和收益保证风险度量方法；第3部分实务篇包括第9章至第11章，主要介绍中国全国社会保障基金发展概况、面临的问题、投资收益情况和全国社保基金投资运作模式，探讨全国社保基金资产配置特征和社保基金操作对市场影响分析。

本书可供金融专业的相关研究人员、高等院校师生以及从事社会保障基金投资运作与风险管理的实际工作者阅读参考。

# <<社会保障基金资产配置策略研究>>

## 书籍目录

### 前言

### 第1部分 基础篇

#### 第1章 社会保障制度

- 1.1 社会保障制度的建立与模式
- 1.2 中国社会保障制度
- 1.3 中国社会保障制度模型
- 1.4 本章小结

#### 第2章 社会保障基金

- 2.1 社会保障基金制度
- 2.2 社会保障基金运作监管模式
- 2.3 两种运作监管模式比较
- 2.4 社会保障基金的运作
- 2.5 本章小结

#### 第3章 社保基金资产配置策略研究综述

- 3.1 研究社保基金资产配置的意义
- 3.2 收益确定型养老基金的资产配置
- 3.3 缴费确定型养老基金的资产配置
- 3.4 统一框架下收益确定型与缴费确定型资产配置
- 3.5 存在的问题和未来研究方向
- 3.6 本章小结

### 第2部分 理论篇

#### 第4章 基于收益保证的资产配置策略

- 4.1 收益保证机制概述
- 4.2 内部收益保证下的资产配置
- 4.3 外部收益保证下的资产配置
- 4.4 本章小结

#### 第5章 基于习惯形成的资产配置策略

- 5.1 习惯形成概述
- 5.2 基于习惯形成的资产配置
- 5.3 通货膨胀下基于习惯形成的资产配置
- 5.4 本章小结

#### 第6章 下边风险测度下资产配置策略

- 6.1 下边风险测度概述
- 6.2 BTSV测度下缴费确定型资产配置
- 6.3 BTSV测度下收益确定型资产配置
- 6.4 本章小结

#### 第7章 收益保证成本估算模型

- 7.1 问题提出
- 7.2 收益保证成本的估算方法
- 7.3 问题描述
- 7.4 结合资产配置策略估算收益保证成本
- 7.5 本章小结

#### 第8章 收益保证风险度量方法

- 8.1 问题提出
- 8.2 结合资产配置策略度量收益保证的风险

## <<社会保障基金资产配置策略研究>>

8.3 随机利率下度量养老基金内嵌收益保证的风险

8.4 本章小结

### 第3部分 实务篇

#### 第9章 中国全国社保基金概况

9.1 中国全国社保基金面临的问题与投资收益

9.2 中国全国社保基金的投资管理模式

9.3 中国全国社保基金发展情况

9.4 中国全国社保基金投资运作

9.5 本章小结

#### 第10章 全国社保基金的资产配置特征

10.1 重仓股的行业配置特点分析与比较

10.2 重仓股的个股特征比较与分析

10.3 社保基金重仓股组合收益风险特征分析

10.4 本章小结

#### 第11章 社保基金操作对市场影响分析

11.1 数据选取及说明

11.2 增仓操作对市场的影响

11.3 减仓操作对市场的影响

11.4 主要结论

11.5 本章小结

### 附录

### 参考文献

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>