第一图书网, tushu007.com

<<风险预算理论与应用>>

图书基本信息

书名：<<风险预算理论与应用>>

13位ISBN编号：9787500599128

10位ISBN编号：7500599129

出版时间：2007-6

出版时间：中国财经

作者：杨筱燕

页数：435

字数：357000

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

内容概要

现代科学技术的发展，促进了风险管理技术的迅速更新；投资者对收益和风险极为关注，寻找超额利益；20世纪90年代，一系列金融危机事件的发生，促使国内外机构投资者和监管者非常重视风险管理，在资产管理过程中，开始重视不断采用新的风险管理技术，建立风险控制流程与有移与投资流程相结合的管理体制。

本书搜集了相关的国内外资料进行整理，从介绍风险预算入手，结合风险预算过程中涉及的风险度量理论、资产配置理论、投资绩效评价理论，并借鉴国外先进的风险管理技术——风险预算，最终结合我国的资本市场和机构投资者投资组合的资产配置实际情况，从风险分解、资产配置、战略风险预算和积极风险预算几个方面对风险预算理论在我国机构投资者资产管理中的应用进行分析和探讨，并提出了我国机构投资者的风险预算模式。

作者简介

杨筱燕：博士，FRM，中央财经大学金融学院金融工程系讲师。
研究领域：期货与期权，金融工程与风险管理。
在各类刊物发表专业论文二十余篇。

2006年，毕业于中央财经大学金融学院。
对投资组合理论、衍生金融工具、资产定价与风险管理模型等有深入研究。

2003-2004年，就职于加拿大Algorithmics中国金融风险实验室，担任金融工程师，从事金融产品定价和金融风险建模工作。
对国内金融机构信用风险、市场风险、资产负债风险等领域进行持续深入的考察、分析和研究。

2005-2006年，就职于PROGNOZ北京办事处，担任高级金融工程师，从事金融风险系统在中国的本土化建模和配置，并负责其在金融行业的咨询服务和应用推广。
工作内容涉及证券公司、保险公司等金融机构风险系统项目的实施、资产定价模型国内验证、情景及期限结构制定、报告模板设计、客户风险报告分析等，具有丰富的实际业务经验。

<<风险预算理论与应用>>

书籍目录

导论第一章 风险预算理论体系 第一节 风险预算的界定 第二节 风险预算理论 第三节 基于风险预算的资产管理模式与资产配置的区别 本章小结第二章 风险预算的技术指标体系 第一节 风险预算的主要技术指标介绍 第二节 风险预算中的TE及ⅡR的计算方法 第三节 风险预算中的资产配置模型选择 第四节 Sp、IR与最优投资组合选择 本章小结第三章 资产管理中的风险预算理论 第一节 战略风险预算及战略资产配置 第二节 积极风险预算与资产配置 第三节 风险预算与绩效归因 本章小结第四章 我国社保基金资产管理中的风险预算应用 第一节 我国社保基金的战略风险预算与资产配置 第二节 我国社保基金的积极风险预算探讨 第三节 我国社保基金风险预算中的风险分解及报告 本章小结第五章 我国保险资产管理中的风险预算应用 第一节 保险资产管理制度及风险预算模式 第二节 风险预算模型——多因素模型分析 第三节 我国保险资产管理中的战略风险预算 第四节 我国保险资产管理的积极风险预算 第五节 投资组合风险分析和预算执行报告 本章小结第六章 我国其他机构投资者资产管理中的风险预算应用 第一节 我国基金管理公司的风险预算 第二节 我国银行资金运用部门的风险预算 第三节 我国企业年金的风险预算 第四节 风险预算在我国机构投资者资产管理中的应用建议本章小结 第七章 主要结论附录一 保险组合风险分析数据附录二 文献综述 一、金融危机案例借鉴 二、风险管理理论和技术发展 三、收益风险的参数估计及模型选择 四、投资绩效评价参考文献后记

第一图书网, tushu007.com

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