

<<保险企业资产负债管理>>

图书基本信息

书名：<<保险企业资产负债管理>>

13位ISBN编号：9787505842465

10位ISBN编号：7505842463

出版时间：2004-8

出版时间：经济科学出版社

作者：王海艳

页数：254

字数：280000

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>

<<保险企业资产负债管理>>

内容概要

本书的内容大致可分为三大部分：首先，前三章概述性地介绍了资产负债管理在保险企业经营管理中的地位、资产负债管理理论的发展脉络以及这一概念本身的内涵，特别是明确了资产负债管理和风险管理。

偿付能力管理之间的关系。

其次，在第四章至第九章的内容中，重点阐述了资产负债管理技术模型的理论基础、方法及在保险公司中的应用。

技术方面的应用，主要从保险企业利率风险的规避、资产负债组合结构的优化选择、风险资本要求的确定三个方面展开，这三方面基本囊括了保险企业资产负债管理的主要技术工作，并将当今学术界和实践界所研究和应用的各种资产负债管理技术总结成四种类型，即免疫技术、均值方差分析技术。

风险价值技术以及动态技术，其中动态技术实际上是作为前三者的补充和辅助。

再次，第十章和第十一章则重点讨论了围绕资产负债管理的组织体系架构问题，通过对组织设计的原则和目标以及对传统保险企业决策弊端的分析，进一步明确了资产负债管理在管理层面上包括组织结构、决策流程、信息沟通和激励约束机制四个方面。

<<保险企业资产负债管理>>

书籍目录

第一章保险企业经营与资产负债管理 第一节 保险企业业务特征 第二节 保险企业的资和和负债 第三节 保险企业的风险 第四节 保险企业加强资产负债管理的必要性第二章资产负债管理理论的历史演进 第一节 资产管理理论 第二节 负债管理理论 第三节 传统的资产负债管理理论 第四节 集成化资产负债管理理论 第五节 保险业资产负债管理理论的发展过程第三章资产负债管理的涵义 第一节 资产负债管理的定义 第二节 资产负债管理与风险管理的关系 第三节 资产负债管理与偿付能力管理的关系 第四节 保险企业资产负债管理体系架构第四章 利率风险及免疫理论 第一节 利率、利率期限结构、利率风险 第二节 利率风险的度量 第三节 免疫基本模型及单因素模型 第四节 多因素模型和无限因素模型 第五节 扩展条件下的免疫 附录：组合价值随利率变动下限的证明第五章免疫技术在保险企业资产负债管理中的应用 第一节 现金流匹配 第二节 持期匹配 第三节 缺口分析 第四节 条件免疫第六章投资组合理论 第一节 有效组合的构造 第二节 资本资产定价模型（CAPM） 第三节 套利定价理论（APT） 第四节 现代投资组合理论的新进展 第五节 投资组合理论与效用理论、集合风险理论的关系第七章均值方差分析在保险企业资产负债管理中的应用 第一节 资产负债定价模型（ALPM） 第二节 财产险机会约束模型 第三节 基于破产约束条年的多阶段均值方差模型 第四节 对均值方差分析技术的评价 附录：求资产负债定价模型的组合解第八章风险价值技术在保险企业资产负债管理中的应用第九章动态技术在保险企业资产负债管理中的应用第十章保险企业组织体系概述第十一章保险企业资产负债管理组织体系设计结束语参考文献

<<保险企业资产负债管理>>

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>