

<<中国企业年金投资运营研究>>

图书基本信息

书名：<<中国企业年金投资运营研究>>

13位ISBN编号：9787509608425

10位ISBN编号：7509608422

出版时间：2010-1

出版时间：经济管理出版社

作者：杨长汉

页数：243

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>

## <<中国企业年金投资运营研究>>

### 内容概要

本书是中国第一本运用金融学和投资学系统研究企业年金投资的创新成果。

本书以莫迪利亚尼的储蓄生命周期理论、兹维·博迪和菲力普·大卫等倡导的养老金金融理论、马克维茨的投资组合理论等为理论基础，运用现代金融学和投资学理论，系统研究企业年金投资运营问题

。

## <<中国企业年金投资运营研究>>

### 作者简介

杨长汉。

笔名杨老金。

2000年以来，参与国际经合组织（OECD）等国际组织、国内相关政府部门、国内外著名金融机构、各类大型企业集团有关企业年金、养老金的课题研发和市场培育。

发表了大量研究成果：专著两部、主编著作三部、译著两部、论文多篇。

“中国企业年金的国民教育”一文获中国劳动和社会保障部优秀论文奖。

其组织出版的《企业年金管理指引》、主编的《企业年金方案设计与管理》和《中国企业年金发展报告》、主译的《养老金治理与投资》为行业发展起到了重要的推动作用。

# <<中国企业年金投资运营研究>>

## 书籍目录

1 导论 1.1 选题背景及意义 1.2 文献综述 1.3 研究内容及思路 1.4 创新点  
2 企业年金投资的理论基础 2.1 企业年金的定义 2.2 养老金及企业年金理论的发展 2.3 企业年金的宏观理论基础 2.4 企业年金的微观理论基础 2.5 企业年金投资的基本理论  
3 世界企业年金的发展历程与经验借鉴 3.1 世界企业年金制度的产生 3.2 世界企业年金制度的发展 3.3 美国的企业年金制度 3.4 日本企业年金制度 3.5 智利养老金私营化改革 3.6 世界企业年金制度发展的动因 3.7 世界企业年金制度发展的经验借鉴  
4 中国企业年金的发展历程与现状 4.1 中国企业年金制度变迁历程 4.2 中国企业年金制度框架 4.3 中国企业年金市场的发展现状 4.4 中国企业年金发展空间和前景 4.5 中国企业年金发展的主要问题 4.6 中国企业年金发展的意义  
5 企业年金投资政策、资产配置 5.1 现代投资组合理论在企业年金投资中的运用 5.2 企业年金投资的特点与原则 5.3 企业年金的投资政策 5.4 企业年金投资战略资产配置 5.5 企业年金投资策略 5.6 企业年金投资组合  
6 企业年金投资工具选择 6.1 货币类资产投资工具 6.2 固定收益类资产投资工具 6.3 权益类资产投资工具 6.4 其他金融投资工具及企业年金投资工具创新  
7 企业年金投资风险管理 7.1 企业年金投资的系统风险 7.2 企业年金投资的非系统风险 7.3 企业年金投资的风险管理实践 7.4 企业年金投资风险的测度 7.5 企业年金风险管理VaR方法  
8 企业年金投资绩效评估与投资管理人选择 8.1 企业年金投资绩效评估的必要性 8.2 企业年金投资绩效评估的目标 8.3 企业年金投资绩效评估的程序 8.4 企业年金基金净值收益率的计算方法 8.5 企业年金投资收益率的评估方法 8.6 企业年金风险调整绩效评估方法 8.7 企业年金择时能力评估 8.8 企业年金绩效归因分析 8.9 企业年金投资管理人的选择与更换  
9 企业年金投资监管 9.1 企业年金投资监管的必要性和主要内容 9.2 目前中国企业年金投资监管的主要内容 9.3 企业年金投资监管的主要模式及其发展  
主要参考文献  
后记

## <<中国企业年金投资运营研究>>

### 章节摘录

一个多世纪以来，特别是第二次世界大战之后，随着社会经济制度和企业年金制度的发展，为适应国家在企业养老金方面的政策需要，西方学者对企业年金制度的各个方面都进行了深入的研究，目的是为企业年金制度建设和企业年金基金管理等活动提供理论基础、指导原则和制度规范。20世纪70年代末，在“石油危机”和“经济滞胀”及人口老龄化的挑战下，西方强调“市场失灵”，推崇政府作用的凯恩斯主义陷入危机，强调“政府失灵”奉行市场主义的新自由主义经济主张蔚然兴起。

新自由主义的哲学基础是自由、公正和不干涉主义，在经济理论和政策上极力推崇自由市场经济，主张政府有限责任理论，反对国家干预，主张限制政府权力和合理界定政府责任边界。

在养老金方面，养老金制度改革普遍引入市场化运作的管理机制，实行市场化与企业及其雇员自我负责相结合，国家、企业和个人共同负担养老金责任，减少国家干预，让市场发挥基础性和主导性作用。

在新自由主义经济思潮的影响下，养老金制度市场化改革进一步深化，市场化、基金制、私有制企业年金制度得到了不断发展和完善。

<<中国企业年金投资运营研究>>

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:<http://www.tushu007.com>