

<<非寿险企业风险度量与区域非寿险市场发展>>

图书基本信息

书名：<<非寿险企业风险度量与区域非寿险市场发展>>

13位ISBN编号：9787308094535

10位ISBN编号：7308094537

出版时间：2012-11

出版时间：浙江大学出版社

作者：滕帆

页数：141

字数：180000

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>

## <<非寿险企业风险度量与区域非寿险市场发展>>

### 内容概要

作为金融体系，特别是保险体系里重要的组成部分，非寿险企业由于承担着“社会专业风险管理者”的角色，在宏观经济中的经济补偿作用日益突出。

因此非寿险企业对自身风险状况的估计不仅是其经营管理，特别是风险管理的基础，还受到其他社会相关利益主体，如保单持有人、政府监管者、行业评级机构的关注，同样也关系到宏观金融的整体安全程度。

《非寿险企业风险度量与区域非寿险市场发展》主要关注的是非寿险企业的风险度量问题，以期为非寿险企业的风险度量提供若干种较为精确、科学且具有较高可操作性的风险度量方法。

本书由滕帆著。

#### 作者简介

滕帆，1977年出生，山东潍坊人，经济学博士，浙江大学宁波理工学院副教授，宁波市保险学会常务理事。

主要研究方向为保险与风险管理、区域金融发展。

已在《统计研究》等学术期刊发表论文10余篇，出版著作2部。

书籍目录

第一章 引言

一、研究意义与目的

- (一)财产保险公司数量成倍递增
- (二)财产保险公司保费规模增长迅速
- (三)财产保险对社会经济的影响程度日益加深

二、研究范围与概念界定

- (一)保险企业
- (二)非寿险业务与非寿险企业
- (三)非寿险企业风险及其度量
- (四)保险市场与区域保险市场

三、研究思路与研究内容

- (一)研究思路
- (二)研究内容

第二章 文献综述

一、风险度量原则

- (一)PS体系
- (二)ADEH体系
- (三)WYP体系
- (四)小结

二、风险度量函数及其估计方法

- (一)风险度量函数
- (二)风险度量值估计方法

三、非寿险企业风险度量方法

- (一)基于监管和外部评级目的的风险度量方法
- (二)基于内部管理需要的风险度量方法

四、简要评述

第三章 整体风险管理视角下的非寿险企业风险度量

一、企业整体风险管理

- (一)风险与风险管理概述
- (二)传统风险管理模式及其缺陷分析
- (三)风险管理的发展：企业整体风险管理

二、非寿险企业整体风险管理的必要性和可行性分析

- (一)必要性分析
- (二)可行性分析

三、非寿险企业整体风险管理中的风险度量

- (一)非寿险企业风险度量的目标
- (二)非寿险企业风险度量的一般过程描述
- (三)非寿险企业风险度量中的两个核心问题

第四章 非寿险企业风险度量方法的选择与创新

一、非寿险企业风险度量的基础方法——期望亏空

- (一)期望亏空及其基本性质
- (二)不同分布条件下期望亏空的解析表达式

二、非寿险企业风险度量的一个新方法——未偿率模型

- (一)模型假设
- (二)资不抵债简单未偿率及其扩展

## <<非寿险企业风险度量与区域非寿险市场发>>

- (三)简单未偿率的基本性质
- (四)简单未偿率的若干数值计算

### 三、相关评述

## 第五章 非寿险企业风险度量值ES、NRR的估计方法

### 一、单一损失分布ES、NRR估计

- (一)参数法(Parametric Method)
- (二)非参数法(Nonparametric Method)
- (三)参数法与非参数法的估计效果比较
- (四)单一损失分布ES、NRR估计的基本结论

### 二、短期聚合风险模型假设条件下ES、NRR估计

- (一)短期聚合风险模型的基本假设
- (二)总理赔量S的ES、NRR估计
- (三)实验设计与结果分析

### 三、多风险条件下整体风险度量

- (一)风险相互独立条件下的加总方法
- (二)风险相关条件下的加总方法

### 四、相关结论

### 五、附录

## 第六章 中国非寿险企业现金流量风险度量的实证分析

### 一、非寿险企业现金流量风险度量的理论分析

- (一)非寿险企业现金流量的匹配形态分析
- (二)非寿险企业现金流量的风险度量方法

### 二、中国非寿险业现金流量的现状分析

- (一)研究思路与数据预处理
- (二)保费收入的模式分析
- (三)赔付支出的模式分析
- (四)保费收入与赔付支出建模后的残差分析
- (五)相关结论

### 三、中国非寿险业现金流量的随机模拟分析

- (一)基本思路
- (二)模拟结果与分析

### 四、相关结论

### 五、附录

## 第七章 区域非寿险市场发展——以宁波为例

### 一、宁波保险市场发展特征

- (一)宁波保险市场发展现状
- (二)调研结果
- (三)政策建议

### 二、宁波车险经营业绩分析

- (一)问题的提出
- (二)调研分析
- (三)成因分析
- (四)政策建议

### 三、宁波财产保险现金流量的VAR分析

- (一)向量自回归模型(VAR)的简介
- (二)宁波财产保险业现金流量的VAR建模
- (三)政策建议

第八章 基本结论与研究不足

一、基本结论

二、研究不足与展望

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>