

<<开放式基金的风险管理>>

图书基本信息

书名：<<开放式基金的风险管理>>

13位ISBN编号：9787505839960

10位ISBN编号：7505839969

出版时间：2004-4

出版时间：经济科学出版社

作者：刘家平著

页数：199

字数：150000

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>

## <<开放式基金的风险管理>>

### 内容概要

本书从中国开放式基金风险管理的需要出发，从开放式基金管理体系和管理技术的应用角度，分析了开放式基金在证券投资时所面临的市场风险以及在资金安全排与基金投资人博弈过程中所面临的流动性风险，力求建立中国开放式基金风险管理体系的基本框架，为基金公司风险管理的实施提供有益的借鉴。

## <<开放式基金的风险管理>>

### 作者简介

刘家平，男，1963年出生，湖北仙桃人。

现为中国人民大学商学院在站博士后，聚合日进资产管理有限公司董事长兼首席执行官。

曾先后就读于武汉理工大学、复旦大学、武汉大学、中国人民大学和宾夕法尼亚大学沃顿商学院，分别获得工学学士、经济学硕士（会计）和经济博士（统计）学位。

曾任大鹏证券、中国科技证券综合研究所所长。

主要从事证券投资、受托资产管理、风险管理等方面的研究。

近几年来，发表论文十多篇。

出版专著3部。

## <<开放式基金的风险管理>>

### 书籍目录

第一章 导论 第一节 研究动因及国内外研究综述 第二节 分析架构与创新第二章 开放式基金风险管理的特性 第一节 开放式基金风险的特性 第二节 开放式基金风险管理的特性第三章 中国开放基金市场风险分析 第一节 开放式基金市场风险分析的方法 第二节 开放式基金市场风险的度量 —— VaR的计算 第三节 收益率时间序列模型 第四节 中国基金市场风险的实证分析第四章 中国开放式基金市场风险的防范 第一节 市场险防范与金融资产配置 第二节 金融资产配置模型 第三节 国际开放式基金资产配置技术在中国的应用 第四节 中国证券投资基金资产配置实证分析第五章 中国开放式基金的流动性风险管理 第一节 开放式基金流动性风险管理分析 第二节 开放式基金流动性风险的度量 第三节 开放式基金流动性风险管理的决策模型 第四节 开放式基金流动性风险管理的规律和对策  
结束语附录参考文献后记

<<开放式基金的风险管理>>

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>