

<<机构投资者投资风险管理>>

图书基本信息

书名：<<机构投资者投资风险管理>>

13位ISBN编号：9787505841215

10位ISBN编号：7505841211

出版时间：2004-4

出版时间：经济科学出版社

作者：杜本峰

页数：194

字数：160000

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>

<<机构投资者投资风险管理>>

内容概要

本书全面系统地分析了现代机构投资者的特性，风险度量与管理的模型和方法，从一般的机理、理论和模型和实证分析三个层次上，通过对风险的性质和风险构成的进行了理论分析，探讨了机构投资者的来源，根据机构投资者的特点，从风险度量方法、投资风险分析了内部风险控制管理体系等方面进行了理论和实证分析。

<<机构投资者投资风险管理>>

作者简介

杜本锋，男，1963年出生，河南通许人，经济学博士，中办民大学副教授，先后就读于河南大学灵敏学系，清华大学经济学院和中国人民大学统计学系，于1984年、1997年和2003年分别获得了理学学士、工商管理硕士和经济学博士学位，主要从事政策分析与管理、调查统计分析与管理

<<机构投资者投资风险管理>>

书籍目录

第一章 导论 第一节 选题意义及国内外研究综述 第二节 研究思路、方法及主要内容第二章 机构投资者风险形成机理 第一节 机构投资者的概念、性质及经济特征 第二节 机构投资者的投资行为分析 第三节 机构投资者投资风险构成分析 第四节 机构投资者风险管理标准及分析经济功能分析第三章 机构投资者市场风险度量方法 第一节 市场风险量方法及其发展 第二节 机构投资者风险度量方法分析 第三节 风险度量模型实证分析与比较第四章 机构投资风险预算分析与控制 第一节 风险预算与投资风险分析 第二节 投资组合风险分析与控制 第三节 风险预算分析与经理人结构优化模型第五章 机构投资者投资内部控制治理分析 第一节 机构投资者投资内部的控制治理的不可或缺性 第二节 我国机构投资者投资管理现状及问题 第三节 机构投资风险内部的控制治理框架构建与运行参考文献

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>