

<<机构投资者集成风险管理理论方法>>

图书基本信息

书名：<<机构投资者集成风险管理理论方法研究>>

13位ISBN编号：9787561226032

10位ISBN编号：7561226039

出版时间：2009-7

出版时间：西北工业大学出版社

作者：姜继娇，杨乃定 著

页数：251

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>

前言

随着我国金融系统改革和开放的不断深入，机构投资者迅速发展起来了。动荡多变的市场环境及自身发展的内在规律性对机构投资者提出了严峻挑战，研究机构投资者集成风险管理问题成为一项紧迫而重要的课题。

该研究具体包含了如何将人的心理行为因素纳入分析框架；怎样从系统角度提出一种新的集成风险管理理论体系；企业项目管理（EPM）模式能否作为集成各种风险管理活动的支撑平台；一般风险管理理论与组合投资决策对接过程的适应性等方面。

对此，本书的撰写按照概念体系—运作机理—优化机制—实证检验的思路展开，体现问题导向的研究特点。

该研究的主要创新工作有以下几个方面。

（1）界定了机构投资者集成风险管理的概念、特点及框架。

针对目前众多机构投资者采用项目管理模式及行为金融思想有力渗透的特点，本书研究提出了中国市场情景下，机构投资者集成风险管理（英文缩写为BF-P-II-IRM）的框架体系。

考虑我国金融市场的独特性及其发展趋势，界定了本书所涉及的机构投资者的内涵；从提供全新风险管理思维角度，分析并给出了行为金融范式的指导意义；利用企业项目管理平台作为支撑，提出了机构投资者风险管理系统集成的具体实现途径；为解决传统的机构投资者风险管理研究的局限性，提出机构投资者集成风险管理的概念、特点及框架。

（2）揭示了机构投资者集成风险管理系统的运作机理。

本书对行为金融范式下基于项目的BF-P-II-IRM运作机理进行了系统研究，开创了BF-P-II-IRM系统优化机制研究的理论基础。

<<机构投资者集成风险管理理论方法>>

内容概要

《机构投资者集成风险管理理论方法研究》介绍了通过对机构投资者风险管理活动的研究，系统地分析了集成风险管理的客观规律。

在行为金融范式下，研究了机构投资者集成风险管理的形成与发展，界定了机构投资者集成风险管理的概念、特点与理论框架，揭示了系统的运作机理，建立了系统优化模型，实证检验了模型中的关键假设。

《机构投资者集成风险管理理论方法研究》适合管理科学与工程专业的研究生使用，也可供金融从业人员和政府部门的相关人员参阅。

作者简介

姜继娇，1979年8月生于山东省巨野县，博士，西北工业大学管理学院副教授。
现主要从事行为金融与风险管理领域的研究工作。
杨乃定，1964年11月生于陕西省户县，博士，西北工业大学管理学院教授、博士生导师。
近年来主持或参加完成国家及省部级课题20余项。
获陕西省哲学社会科学优秀研究成果及省高校人文社会科学优秀研究成果、科技进步奖等7项。

书籍目录

第1章 绪论1.1 研究背景与意义1.2 国内外研究综述1.3 研究的内容、思路和框架第2章 机构投资者集成风险管理概念、特点及框架2.1 理论前提2.2 BF-P-IRM的概念与特点2.3 BF-P-IRM的框架研究2.4 本章小结第3章 机构投资者集成风险管理系统运作机理3.1 BF-P-IRM的模块研究3.2 BF-P-IRM的模块界面管理研究3.3 BF-P-IRM动态协作的复杂性研究3.4 本章小结第4章 机构投资者集成风险管理系统优化机制4.1 基于管理熵的系统优化方法研究4.2 BF-P-IRM绩效评价问题研究4.3 基于BPT的系统核心决策机制研究4.4 本章小结第5章 机构投资者集成风险管理实证研究5.1 研究方案设计5.2 实验数据采集5.3 数据分析与结果讨论5.4 本章小结第6章 结论与研究展望6.1 主要结论及创新点6.2 研究局限与进一步的工作参考文献

章节摘录

第2章 机构投资者集成风险管理概念、特点及框架 机构投资者是一个复杂动态开放的系统，有效的IRM活动必须根据组织战略要求，从整体角度出发整合各种风险管理活动。迄今为止，理论界运用多学科如数学、心理学、管理学等自然科学和社会科学理论知识，已提出了为数不少的风险识别、分析、评价及控制的理论方法，然而系统的风险管理理论还集中在非常有限的领域。

目前，风险管理理论的研究以集成为主流，但对机构投资者来说还没有真正达到集成风险管理的水平。

值得肯定的是，有许多学者已从不同角度研究了企业各个层面的风险集成问题，提出了多种风险集成管理模式，并在保险行业进行了有益的探索。

由于ERM理论体系是在标准金融范式下发展而来的，它与行为金融和企业项目管理的交叉研究非常缺乏，这就对机构投资者风险管理造成两种不利的影响。

虽然行为金融理论发展非常迅速，但毕竟还局限在对金融风险的研究层面，尚未发展到集成风险管理要求的战略层面。

机构投资者即使建立了较为成熟的企业项目管理模式，但却无法为风险管理活动提供集成平台。因此，金融风险与其他风险、EPM与ERM的隔离，日益成为制约机构投资者集成风险管理理论发展的瓶颈，迫切需要BF—P—IRM这一课题展开深入系统的研究。

.....

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>