

<<私募基金风险管理研究>>

图书基本信息

书名：<<私募基金风险管理研究>>

13位ISBN编号：9787010060538

10位ISBN编号：7010060533

出版时间：2007-2

出版时间：人民出版社

作者：王苏生 等著

页数：268

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>

## <<私募基金风险管理研究>>

### 内容概要

本书以私募基金风险管理为研究对象，旨在结合国外私募基金风险管理的成功经验与我国实际情况，探索一套适合中国国情的私募基金全面风险管理体系。

全书由三部分组成：第一部分，介绍私募基金风险管理的基础，包括私募基金概念、组织形式、特点，私募基金行业风险及其影响，私募基金风险管理研究的意义，以及风险管理系统的要求，分析如何评估风险容忍度；第二部分，从定性研究与定量研究相结合的角度分析各单项风险管理技术，包括市场风险、经营风险、信用风险等，并在此基础上阐释风险预算这种综合风险管理技术；第三部分，提出并探讨未来需要解决的主要风险管理问题，包括续存偏差、动态风险、非线性风险、流动性风险、风险偏好等。

全书逻辑严谨，论证严密，资料丰富，有着较高的理论价值和学术价值。

## <<私募基金风险管理研究>>

### 作者简介

王苏生，1969年生于湖北洪湖。

现为哈尔滨工业大学深圳研究生院教授、博士生导师、经济管理学部主任，美国特许金融分析师（CFA）。

先后获得中国人民大学经济学硕士、北京大学法学博士、美国芝加哥大学MBA等学位，2000-2002年于清华大学经济管理学院从事博士后研究。

自1993年以来，先后在国内主要证券公司担任管理职务，曾任中外合资创业投资基金管理公司负责人。

已出版《证券投资基金管理人的责任》、《要约收购的理论与实证研究》、《管理层收购——杠杆收购及其在公司重组中的应用》等专著。

## <<私募基金风险管理研究>>

### 书籍目录

序 我们迫切需要实用的风险控制技术第一章 导论 第一节 私募基金概述 第二节 私募基金行业的风险  
第三节 私募基金风险的影响 第四节 私募基金风险管理研究的重要意义 第五节 风险管理系统的要求  
第二章 评估风险容忍度 第一节 生命周期 第二节 风险容忍度的影响因素 第三节 风险容忍度评估办法  
第四节 风险容忍度评估表第三章 市场风险管理技术 第一节 基于定价理论的风险管理技术 第二节 市  
场风险VaR 第三节 压力测试 第四节 事后检验 第五节 基于收益的投资风格分析第四章 经营风险管理  
技术 第一节 经营风险管理基础 第二节 经营风险理化控制技术 第三节 经营风险VaR 第四节 Near-Miss  
模型第五章 信用风险管理技术 第一节 信用风险管理基础 第二节 信用风险分析模型 第三节 信用风险  
管理手段第六章 风险预算 第一节 风险预算概述 第二节 风险预算框架 第三节 风险预算与其他风险管  
理技术的比较第七章 未来需要解决的主要风险管理问题 第一节 续存偏差 第二节 动态风险 第三节 非  
线性风险 第四节 流动性风险 第五节 风险偏好参考文献

<<私募基金风险管理研究>>

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>