

<<寿险公司整合性风险管理研究>>

图书基本信息

书名：<<寿险公司整合性风险管理研究>>

13位ISBN编号：9787810889049

10位ISBN编号：7810889044

出版时间：2008-5

出版单位：北京科文图书业信息技术有限公司

作者：陈志国

页数：330

字数：260000

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>

## <<寿险公司整合性风险管理研究>>

### 内容概要

本书基于寿险公司整合性风险管理构架进行理论与运行研究，以公司整合性风险管理产生的背景为起点，以经济金融理论、财务理论、风险社会与风险文化理论为理论基础，建立了基于价值创造的公司整合性风险管理理论体系，建构寿险公司整合性风险管理模型，并对所建模型进行扩展运用，形成了资本风险的整合管理、资产负债风险的整合管理、战略风险与经营风险的整合管理、风险管理与风险管理文化的整合管理的递阶式风险整合管理体系。

本书（导论）认为，公司整合性风险管理是经济全球化和金融混业经营对企业传统风险管理的挑战、金融市场与金融工程对风险管理的促进、企业风险管理实践的內部创新与外部机构的外部压力的驱动以及系统控制论与计算机技术的技术支持等背景决定的必然产物。

# <<寿险公司整合性风险管理研究>>

## 书籍目录

导论 一、公司整合性风险管理产生的背景 (一) 经济全球化背景下的企业组织对传统风险管理提出严峻挑战 (二) 金融市场与金融工程的发展为公司整合性风险管理提供了重要条件 (三) 企业风险管理实践促进了公司整合性风险管理的发展 (四) 监管机构、评级机构等的外部压力是公司整合性风险管理发展的外部驱动力 (五) 控制论、系统论与计算机技术的运用为整合性风险管理发展提供技术支持 二、文献综述、实践进展与研究现状 (一) 文献综述 (二) 实践进展 (三) 研究现状 三、本书研究方法：整体分析方法 (一) 整体分析方法的理论渊源 (二) 整体分析方法的基本内容 (三) 整体分析方法在本书的方法论运用 四、研究目的、研究思路、逻辑结构与研究创新 (一) 本书研究目的 (二) 研究思路与逻辑结构 (三) 本书创新之处

第一章 公司整合性风险管理理论 一、整合性风险管理的经济理论基础 (一) 风险态度与效用函数 (二) 风险组合与分散原理 (三) 企业套期保值的基本原理 二、整合性风险管理的金融理论基础 (一) Markowitz的资产组合理论 (二) 资本资产定价模型(CAPM) (三) 期权定价模型 三、整合性风险管理的财务理论基础 (一) 代理理论 (二) 破产成本理论 (三) 企业融资成本理论 (四) 税率曲线论 四、整合性风险管理的社会文化理论基础 .....第二章 公司整合性风险管理理论构建

第三章 寿险公司整合性风险管理模型构建第四章 寿险公司资本结构、资本成本与资本配置的整合风险管理第五章 寿险公司资产负债整合风险管理第六章 寿险公司战略风险与经营风险的整合管理 第七章 寿险公司的风险管理与风险管理文化的整合研究第八章 寿险公司整合性风险管理案例分析参考文献后记致谢

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>