

# 《开放式基金风险分析与风险管理研究》

## 图书基本信息

书名：《开放式基金风险分析与风险管理研究》

13位ISBN编号：9787500572350

10位ISBN编号：7500572352

出版时间：1900-01-01

出版社：

作者：李克强

版权说明：本站所提供下载的PDF图书仅提供预览和简介以及在线试读，请支持正版图书。

更多资源请访问：[www.tushu000.com](http://www.tushu000.com)

# 《开放式基金风险分析与风险管理研究》

## 内容概要

《开放式基金风险分析与风险管理研究》分为六章1 风险分析与风险管理的理论：回顾与评述，2 开放式基金风险与风险管理的一般分析，3 开放式基金投资风险理论及实证分析，4 开放式基金流动性风险的理论与实证分析，5 开放式基金道德风险形成机理及其治理结构，6 防范风险的外在制度安排。

# 《开放式基金风险分析与风险管理研究》

## 书籍目录

导论1 问题的提出2 研究目的3 国内外研究概况4 基本范畴界定5 研究对象及研究视角6 研究的基本思路和基本研究方法7 研究的重点、难点及创新点1 风险分析与风险管理的理论：回顾与评述1.1 风险分析的微观经济学基础——不确定下选择理论1.2 委托代理理论1.3 现代投资组合管理理论1.4 VAR:现代风险管理技术1.5 投资基金收益风险的评价2 开放式基金风险与风险管理的一般分析2.1 开放式基金概述及其风险分类2.2 开放式基金产品的特性2.3 开放式基金风险管理一般分析3 开放式基金投资风险理论及实证分析3.1 投资风险的形成机理3.2 我国开放式基金投资风险的现实考察3.3 投资风险的防范与控制3.4 案例分析4 开放式基金流动性风险的理论与实证分析4.1 流动性风险的形成机理4.2 我国开放式基金流动性风险的现实考察4.3 流动性风险控制的策略与工具5 开放式基金道德风险形成机理及其治理结构5.1 道德风险形成机理分析5.2 道德风险与基金治理结构5.3 我国开放式基金治理结构的一般分析5.4 我国基金治理结构的改进6 防范风险的外在制度安排6.1 资本市场制度安排6.2 基金业管理体制与监管制度6.3 开放式基金业绩--风险评价体系结语附录1：中国证券投资基金大事记附录2：中华人民共和国证券投资基金法参考文献

# 《开放式基金风险分析与风险管理研究》

## 章节摘录

同时，正是在开放式基金管理者权衡投资所面临的风险水平与自身的风险偏好、承担风险的能力进而决定承担多少风险、转移多少风险这种风险管理的过程中，开放式基金实现了其重要的风险配置功能。

(2) 提高开放式基金竞争力的基础是风险管理。开放式基金的核心技能在于为得到收益而必须管理风险，因为开放式基金经营的根本在于找出风险，从风险中获得利润--包括使用风险吸收、风险中介、风险转移等手段。因此，风险管理是开放式基金经营管理的基石和核心，是提高竞争力、建立战略优势的基础。

(3) 开放式基金风险管理主体是多层次的。开放式基金风险管理有仅包括基金管理公司这种微观主体的风险管理活动，基金行业自律行为，而且也包括监管部门的监管行为。有关开放式基金风险管理的层次问题在下一节将进行详细的分析。

(4) 开放式基金风险管理的内容包括风险识别、风险衡量、风险处理和风险监控。从识别到风险管理的监督是一个运动周期，在这每一个周期中，风险管理可达到预期的目标。风险识别是基金管理者（包括基金监管者）对开放式基金运行过程中可能面临的风险因素的识别。风险识别主要是调查开放式基金运行中面临的所有潜在风险是否存在、分析产生风险的各种原因，风险识别主要回答：有哪些风险应当考虑？引起这些风险的主要因素是什么？这些风险引起后果的严重程度如何？

风险衡量是对风险水平的分析和估量，包括估量各种损失发生的可能性的分布以及损失发生的规模和程度。风险衡量与风险识别密切相关，风险衡量实际上是在风险识别的基础上对风险环境认识的进一步深化。 .....

# 《开放式基金风险分析与风险管理研究》

## 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:[www.tushu000.com](http://www.tushu000.com)