

考虑供应商违约风险的CVaR最优订货模型

安智宇^{1,2}, 周晶¹

1. 南京大学工程管理学院, 南京210093;
2. 南京理工大学经济管理学院, 南京210094

Manufacturer's Procurement Decision Based on CVaR for Supplier with Default Risk

AN Zhi-yu^{1,2}, ZHOU Jing¹

1. School of Management and Engineering, Nanjing University, Nanjing 210093, China;
2. School of Economics and Management, Nanjing University of Science and Technology, Nanjing 210094, China

- 摘要
- 参考文献
- 相关文章

Download: PDF (0KB) HTML (1KB) Export: BibTeX or EndNote (RIS) Supporting Info

摘要 供应商违约引发供应中断或延迟会使下游制造商造成巨大损失。同时考虑了供应商具有随机的违约概率及需求不确定的情况,基于CVaR的风险度量准则,建立了基于条件风险价值最小的制造商最优订货模型,数值分析表明订货量与供应商可靠性具有正相关性;当制造商风险参数很高时,可靠性只有达到一定程度,订货量才会有较大幅度提高;当供应商可靠性较低时,降低预定价格会吸引更多的订货。

关键词: 供应链中断 CVaR 最优订货 风险管理

Abstract: Considering the suppliers with both default risk and uncertain demand, this paper proposes a model for procurement decision based on the conditional value-at-risk (CVaR) model. The impact on the procurement decision from the supplier's reliability, the manufacturer's parameter of risk, the price and the losing of opportunity is analyzed.

收稿日期: 2008-07-07;

基金资助:

国家自然科学基金资助重点项目(70831002); 国家自然科学基金资助项目(70571033); 南京理工大学经济管理学院高层次课题预研基金项目(jggy0610)

作者简介: 安智宇(1978-),女(汉族),吉林辽源人,南京大学工程管理学院博士生,南京理工大学经济管理学院讲师研究方向:供应链风险管理。

引用本文:

安智宇, 周晶. 考虑供应商违约风险的CVaR最优订货模型[J]. 中国管理科学, 2009, V17(2): 66-70

没有本文参考文献

[1] 杜红军, 王宗军. 基于Copula-AL法的VaR和CVaR的度量与分配 [J]. 中国管理科学, 2012, (3): 1-9

[2] 李建斌, 杨瑞娜. 现货价格和需求关联时期权组合合约模式下采购风险管理策略[J]. 中国管理科学, 2011, 19(1): 12-20

[3] 于春云, 赵希男, 彭艳东, 潘德惠. 基于条件风险值理论的供应链优化与协调模型研究[J]. 中国管理科学, 2007, 15(3): 31-39

[4] 姜继娇, 杨乃定. 基于行为金融的证券组合风险管理研究[J]. 中国管理科学, 2005, (3): 32-36

[5] 杜本峰. 因子模型在风险预算分析中的应用[J]. 中国管理科学, 2004, (3): 44-47

[6] 井润田, 左齐. 信贷风险管理系统的开发实践[J]. 中国管理科学, 2002, (5): 30-34

[7] 马超群, 李红权, 周恩, 杨晓光, 徐山鹰, 张银旗. 风险价值方法及其实证研究[J]. 中国管理科学, 2001, (5): 16-23

Service

- 把本文推荐给朋友
- 加入我的书架
- 加入引用管理器

- Email Alert
- RSS

作者相关文章

- 安智宇
- 周晶

- [8] 王核成, 陶力一, 张远福.项目风险分析与管理[J]. 中国管理科学, 1998,(4): 15-21
- [9] 夏玉森, 汪寿阳, 邓小铁.金融数学模型[J]. 中国管理科学, 1998,(1): 1-9
- [10] 杨建平, 杜端甫.重大工程项目风险管理中的综合集成方法[J]. 中国管理科学, 1996,(4): 24-28