

基于条件风险值理论的供应链优化与协调模型研究

于春云^{1,2}, 赵希男¹, 彭艳东², 潘德惠¹

1. 东北大学工商管理学院 沈阳110041;

2. 东北大学秦皇岛分校 秦皇岛066004

Study of Supply Chains Optimization and Coordination Model Based on Conditional Value-at-Risk

YU Chun-yun^{1,2}, ZHAO Xi-nan¹, PENG Yan-dong², PAN De-hui¹

1. College of Business Administration, Northeast University, Shenyang 110041, China;

2. Qinghuangdao Branch, Northeast University, Qinghuangdao 066004, 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 本文将近年来发展起来的金融风险控制工具——条件风险值,引入具有风险规避特性的供应链优化与协调问题的研究.建立了随机需求下由具有不同风险规避特性的单个供应商与单个零售商组成的两级供应链的条件风险值模型和基于条件风险值的最优订购量模型及协调供应链的收入共享契约模型,并对模型进行了分析,揭示了供应商和零售商的风险规避程度对最优订购量、批发价格及供应链协调的影响.最后通过一个算例对模型进行了仿真,仿真结果进一步验证了本文的研究结论.

关键词: 条件风险值(CVaR) 风险规避 供应链优化与协调 收入共享契约模型

Abstract: In this paper we introduce the financial risk control tool,the conditional value-at-risk,to study risk-averse supply chains optimization and coordination mechanism problem.First,for a two-echelon supply chain with a risk-averse supplier and risk-averse retailer,we construct the conditional value-at-risk model,the optimal ordering quantity model and the revenue-sharing contract model based on CVaR under random demand.Then,we analyze the model and reveal the impact of risk aversion on supply chains coordination,the optimal ordering quantity and the trade price decisions.Finally,we have also given numerical results to verify the conclusions presented in this paper.

收稿日期: 2006-10-31;

作者简介: 于春云(1962-),女(汉族),河北秦皇岛人,东北大学工商管理学院副教授,研究方向:供应链管理、经济管理决策模型.

引用本文:

于春云, 赵希男, 彭艳东等. 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

没有本文参考文献

- [1] 徐贤浩, 陈雯, 彭红霞. 基于策略消费者行为和市场细分的联合定价库存策略[J]. 中国管理科学, 2012,20(6): 78-86
- [2] 阙红星, 杨善林, 吴晓琴. 一种软件自动测试风险判别和规避模型[J]. 中国管理科学, 2008,16(5): 123-127
- [3] 谢刚, 张金隆. 基于VPRS的软件项目投标风险规避群决策研究[J]. 中国管理科学, 2006,(2): 71-76
- [4] 陈赤军, 叶焕庭. 风险规避与企业的产生和发展[J]. 中国管理科学, 1999,(3): 1-10

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

- 于春云
- 赵希男
- 彭艳东
- 潘德惠

