

<<资产组合风险度量与选择优化>>

图书基本信息

书名：<<资产组合风险度量与选择优化>>

13位ISBN编号：9787509506264

10位ISBN编号：7509506263

出版时间：2008-7

出版时间：中国财经
出版社

作者：刘志东

页数：245

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>

<<资产组合风险度量与选择优化>>

内容概要

《资产组合风险度量与选择优化：理论分析与实证研究》第5、6章主要研究资产组合选择问题。第1章首先介绍论文研究的背景和研究的意义，之后对与论文所研究的问题相关文献资料进行详细的述评。

第2章重点对LPMn、VaR和CVaR等Downside - Risk风险度量方法的原理和计算方法进行系统研究。

第3章主要根据传统EVT理论不能适应金融市场动态变化特征；GARCH模型不能完全解释金融资产收益率厚尾性的缺陷，建立一种基于GARCH模型和EVT模型的金融资产风险度量模型，并给出了模型的计算方法。

第4章本章是根据资产组合中金融资产收益的相关性，研究如何度量资产组合的风险。

第5章主要是结合VaR和CVaR等新的风险度量方法，对Markwitz的均值一方差资产组合选择模型进行拓展，研究在更具有一般性的均值一风险准则下的资产组合选择。

第6章主要讲述资产组合选择面临的难题，对模型的选择，计算流程设计，收益非正态分布下的选择边界等问题的研究。

在金融市场环境将变得更加复杂和难以预测，市场状况瞬息万变的背景下，金融资产组合管理在我国也将会日益受到重视。

<<资产组合风险度量与选择优化>>

书籍目录

第1章 引言1.1 本书研究的背景和研究的意义1.2 文献评述1.3 本书主要解决的问题1.4 本书的结构安排第2章 Downside - Risk风险度量方法2.1 方差作为风险度量方法的不足2.2 LPM风险度量方法2.3 VaR风险度量方法2.4 CVaR风险度量方法2.5 各种Downside - Risk风险度量方法的比较研究2.6 本章小结第3章 基于GARCH - EVT的金融资产风险度量方法3.1 金融资产动态风险度量模型3.2 无条件极值理论3.3 条件极值分布：无条件极值分布和GARCH模型的组合3.4 实证研究3.5 本章小结第4章 Copula函数在资产组合风险度量中的应用4.1 Copula函数与多元分布函数4.2 随机变量之间的相关性研究4.3 金融资产收益率的相关性分析4.4 选择合适的Copula函数度量资产组合风险4.5 基于Copula函数的资产组合风险度量模型4.6 实证研究：Copula函数在我国证券资产组合风险度量中的应用4.7 本章小结第5章 资产组合选择问题的理论分析5.1 关于资产组合选择的相关理论分析5.2 风险—收益准则下的资产组合选择问题5.3 均值—风险准则下的资产组合有效前沿5.4 VaR和CVaR风险度量方法对资产组合选择的影响5.5 本章小结第6章 收益率非正态分布条件下的资产组合选择6.1 资产组合选择面临的难题6.2 基于Copula函数的资产组合选择模型6.3 基于混合遗传算法的资产组合选择计算流程设计的组合6.4 收益率非正态分布条件下的资产组合选择边界6.5 度量收益率的实际分布和相关性对资产组合选择绩效的影响6.6 基于均值—风险准则的资产组合选择模型效率实证研究6.7 本章小结第7章 结论与展望附录附表1 VaR返回测试结果一览表附表2 随机扰动项不同分布假设条件下的CVaR和VaR比例关系附表3 基于混合遗传算法的资产组合选择权重参考文献后记

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>