

<<投资组合保险及策略研究>>

图书基本信息

书名：<<投资组合保险及策略研究>>

13位ISBN编号：9787501780419

10位ISBN编号：7501780412

出版时间：2007-6

出版时间：中国经济

作者：姚远

页数：174

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>

<<投资组合保险及策略研究>>

内容概要

投资组合保险是无套利均衡在金融工程中处理风险问题的应用，是投资者规避风险的重要策略。本书利用无套利均衡分析及动态复制技术，结合Merton(1971)最优消费和投资组合策略模型，建立了连续时间模型条件下投资组合保险模型，并进行优化。在此基础上研究了不同股价运动条件下投资组合保险策略的有效性、市场风险性及其投资者的市场特性。

<<投资组合保险及策略研究>>

作者简介

姚远，女，1975年生。

1997年毕业于天津商学院管理信息系统专业，2000年获西南交通大学管理科学与工程硕士学位，2006年获西南交通大学管理科学与工程博士学位。

现为河南大学工商管理学院讲师，承担硕士研究生“金融工程”、“专业英语”、本科生“运筹学”等课程的教学工作，管理科学与工程研究所专职研究员，研究领域金融工程与金融风险管理。

<<投资组合保险及策略研究>>

书籍目录

第1章 绪论 1.1 投资组合保险理论的发展 1.2 国内外研究现状 1.2.1 国外研究现状 1.2.2 国内研究现状 1.2.3 评述 1.3 问题的提出 1.4 研究框架 1.5 主要研究方法、目的和意义第2章 投资组合保险市场模型 2.1 投资组合保险及其分类 2.1.1 投资组合保险 2.1.2 投资组合保险分类 2.1.3 静态组合保险策略与期权 2.1.4 动态投资组合保险策略 2.2 动态无套利均衡分析 2.2.1 股价运动规律 2.2.2 无套利均衡分析 2.2.3 风险中性定价分析 2.3 等价鞅测度 2.3.1 信息结构 2.3.2 等价鞅测度 2.3.3 凯麦隆—马丁—格萨诺夫定理 2.4 投资组合保险模型 2.4.1 完备市场假设 2.4.2 投资组合保险市场模型 2.5 本章小结第3章 投资组合保险模型最优化研究 3.1 投资组合保险的最优化 3.1.1 模型变型 3.1.2 模型最优化 3.1.3 最优组合保险策略集 3.2 不同风险偏好下投资组合保险模型的最优化 3.2.1 对数效用函数下的最优组合保险模型 3.2.2 负指数效用函数下的最优组合保险模型 3.2.3 等弹性效用函数下的最优组合保险模型 3.2.4 结论 3.3 投资组合保险价值分析 3.3.1 风险资产价格对投资组合保险价值影响分析 3.3.2 投资组合保险收益价值分析 3.3.3 投资组合保险成本价值分析 3.4 本章小结 第4章 不同运动规律下投资组合保险分析第5章 投资组合保险市场特性分析第6章 投资组合保险实证分析第7章 结论参考文献致谢

<<投资组合保险及策略研究>>

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:<http://www.tushu007.com>