

<<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>