

<<基于下方风险控制的动态投资组合理论>>

图书基本信息

书名：<<基于下方风险控制的动态投资组合理论与方法研究>>

13位ISBN编号：9787511605894

10位ISBN编号：7511605893

出版时间：2011-6

作者：王秀国

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>

<<基于下方风险控制的动态投资组合理论>>

内容概要

《基于下方风险控制的动态投资组合理论与方法研究》讲述了：投资组合理论取得了丰富的研究成果，并广泛应用于实践，但在实际中也遇到和提出了更多的新问题和困难。

首先用方差度量风险具有很大的局限性：方差作为概率统计中描述离散程度的量，只反映了收益偏离均值的程度，并没有反映出投资组合损失的程度；在实际中高于均值的超额收益部分是投资者所偏好的，而在Maikowitz的均值方差模型中却被当作风险来对待，从心理学的角度来讲有违投资者对风险的真实心理感受。

因此以方差作为风险度量指标一直受到多方面的批评，许多学者不断寻求新的风险度量方法。

另外均值方差模型是一个静态模型，仅仅考虑了单阶段的投资组合问题，然而实践中投资者往往根据投资环境和市场变化适时调整投资组合头寸，这就需要建立动态投资组合理论。

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>