



首页
概况
研究机构
学者介绍
成果文库
文献数据
培训教育
对外交流

□ 您的位置: 首页 → 数技经济研究杂志 → 理论与方法研究

交易费用和CVaR风险测度下的稳健投资组合

摘要: 本文在考虑投资组合问题时, 考虑了下面三个方面的问题: (1) 交易费用对投资组合选择的影响; (2) 投资组合的目标选择的是使相容风险最小而不是传统的方差最小; (3) 在正态情形下考虑了稳健投资组合选择问题。同时给出了利用一般线性规划方法对模型进行验证的方法。

关键词: 投资组合, 交易费用, 相容风险测度, CVaR, 稳健组合

Search the Web

Find It

地址: 北京市建国门内大街5号 邮政编码: 100732 电话及传真: 010-65125895、010-65137561

版权所有 (c) 中国社会科学院数量经济与技术经济研究所

联系我们 E-mail to: iqte@cass.org.cn