

[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](#)

Search the Web

Find It

您的位置： [首页](#) → [数技经济研究杂志](#) → [现实经济问题研究](#)

基于半方差的投资项目风险度量模型研究

[摘要]采用正确有效的方法度量投资项目风险，对投资项目实践活动有着重要的现实意义。本文分析了方差、半方差方法作为风险测度的不足之处，并针对半方差的一些性质，结合随机控制理论的思想，对半方差模型进行一定的改进，为理性的项目投资者提供了一种决策的依据。

关键词 半方差 随机控制理论 风险 收益

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