



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

## 多金融资产风险价值的Copula计量方法研究

**内容摘要:** 本文侧重研究多金融资产风险价值 (VaR) 的计量方法。首先讨论传统的金融资产风险价值VaR计量方法; 然后利用Copula联结函数、混合分布和Jacob矩阵构造出多金融资产风险价值的Copula计量方法; 最后指出风险价值的Copula计量方法研究的相关问题。

**关键词:** 风险价值, Copula联结函数, 混合分布, 多金融资产, 投资管理。

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