



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 → 现实经济问题研究

Bayes风险值

摘要: 风险值 (VaR) 是最近十几年发展起来的一种市场风险度量尺度, 目前国际上最常用的金融市场风险度量基准。传统的VaR估计方法基本上都是依赖于历史数据的, 并且只能在市场处于正常变动时衡量所面临的风险。由于金融市场中影响资产收益状况的因素时刻都在变化之中, 资产收益分布中的参数也是不断变化的, 因此用Bayes方法预测未来收益状况的VaR更合适。本文给出了B VaR和BC VaR的概念, 讨论了B VaR的性质与特点, 并对市场因子服从正态分布时组合B VaR以及非线性组合B VaR的计算进行了研究。

关键词: 风险值, Bayes风险值, 置信水平, 先验分布, 预测分布

Search the Web

Find It