

全面风险管理体系中的风险整合问题

高志强,张梦琳

收稿日期 修回日期 网络版发布日期 接受日期

摘要 假设风险满足一定条件,利用Copula和蒙特卡洛模拟方法对边际分布的选择和边际分布间的尾部相关关系两个方面进行分析,并得出结论: 第一,在一定条件下,边际分布的选择并不影响对总风险的估计; 第二,相关系数模型可能因为边际分布间的尾部相关关系而低估总风险.在此基础上,提出了尾部相关系数的概念,得出了修正的相关系数模型.

关键词 [全面风险管理\(ERM\)](#) [风险整合](#) [相关系数模型](#) [边际分布](#) [尾部相关性](#)

分类号

DOI:

对应的英文版文章: [2009120073](#)

通讯作者:

作者个人主页: 高志强;张梦琳

扩展功能
本文信息
▶ <a href="#">Supporting info</a>
▶ <a href="#">PDF (624KB)</a>
▶ <a href="#">[HTML全文](0KB)</a>
▶ <a href="#">参考文献[PDF]</a>
▶ <a href="#">参考文献</a>
服务与反馈
▶ <a href="#">把本文推荐给朋友</a>
▶ <a href="#">加入我的书架</a>
▶ <a href="#">加入引用管理器</a>
▶ <a href="#">引用本文</a>
▶ <a href="#">Email Alert</a>
相关信息
▶ <a href="#">本刊中 包含“全面风险管理(ERM)”的 相关文章</a>
▶ 本文作者相关文章
· <a href="#">高志强</a>
· <a href="#">张梦琳</a>