

基于行为金融的证券组合风险管理研究

姜继娇, 杨乃定

西北工业大学管理学院, 西安, 710072

Study on Portfolio Risk Management Based on Behavioral Finance

JIANG Ji-jiao, YANG Nai-ding

Management School, Northwestern Polytechnical University, Xi' an 710072, China

- 摘要
- 参考文献
- 相关文章

Download: PDF (KB) [HTML](#) (KB) Export: BibTeX or EndNote (RIS) Supporting Info

摘要 考虑人的心理行为因素,引入行为金融理论于风险管理主体的决策体系,指出了管理者的有限理性心理结构;基于BSV(Barberis-Shleifer-Vishny)思想建立了一种风险度量模型,据此调整了传统的行为证券组合理论;算法释例结果表明,该模型接近证券组合风险决策的实际情景。

关键词: 行为金融 证券组合 风险管理 有限理性 心理帐户

Abstract: Considering mental factors,behavioral finance is introduced into decision-making system of risk management executors. Bounded rational mental structures of managers are pointed out.It' s formed the risk measurement model based on BSV(Barberis-Shleifer-Vishny) ideology,by which the traditional behavioral portfolio theory is adjusted.Simulation results show it' s approaching the practical situation.

收稿日期: 2004-07-12;

基金资助:国家软科学研究计划项目(2003DGS3B034);西北工业大学博士论文创新基金项目(CX200425)

引用本文:

姜继娇, 杨乃定 .基于行为金融的证券组合风险管理研究[J] 中国管理科学, 2005,V(3): 32-36

Service

把本文推荐给朋友
加入我的书架
加入引用管理器

Email Alert
RSS

作者相关文章

姜继娇
杨乃定

没有本文参考文献

没有找到本文相关文章