

## 基于风险计量指标的证券组合投资的数学模型及其应用

沈小春<sup>1</sup>, 谢敦礼<sup>2</sup>

1. 浙江证券有限责任公司, 浙江杭州310006;

2. 浙江大学管理学院, 浙江杭州310028

## Mathematical Model for Security Portfolio based on Risk Measure Index and Practical Example

SHEN Xiao-chun<sup>1</sup>, XIE Dun-li<sup>2</sup>

1. Zhejiang Security Co., Ltd, Hangzhou 310006, China;

2. Management School, Zhejiang University, Hangzhou 310028, 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** 本文建立的证券组合投资的数学模型采用风险系数 $\beta$ 作为控制证券投资风险的参数,其经济意义明确,实用性强。该模型应用于证券组合投资,效果明显,操作方便。

**关键词:** [证券组合投资](#) [风险控制](#) [数学模型](#)

**Abstract:** This article constructed a mathematical model, and concluded that the economic meaning was definite and practical if we used risk coefficient  $\beta$  to control the risk of security portfolio. The model could be applied to security portfolio, which was convenient in practice.

收稿日期: 2000-12-22;

引用本文:

沈小春, 谢敦礼. 基于风险计量指标的证券组合投资的数学模型及其应用[J] 中国管理科学, 2001, V(3): 6-12

### 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

[沈小春](#)

[谢敦礼](#)

没有本文参考文献

没有找到本文相关文献

