

金融系统鲁棒优化



[金融系统鲁棒优化_下载链接1](#)

著者:高莹

出版者:

出版时间:2008-6

装帧:

isbn:9787505872257

《金融系统鲁棒优化:模型与应用》介绍了金融系统鲁棒性和金融鲁棒优化模型以及国内外学者在金融鲁棒优化方面的相关成果；以我国金融市场为依托，建立了基于线性矩阵不等式的跟踪误差投资组合鲁棒优化模型、具有VaR约束的跟踪误差投资组合鲁棒优化模型、银行卡网络资金运作鲁棒优化模型、多阶段最坏情况的金融资产配置鲁棒优化模型和动态金融资产配置的鲁棒运作保成本控制模型，并进行了应用研究。对于不确定环境下投资决策的合理有效、对于加强金融风险管理、对于满足金融机构对资产配置理论的应用实践要求具有重要的理论意义和实际价值。

作者介绍:

目录:

[金融系统鲁棒优化_下载链接1](#)

标签

金融

科学

评论

[金融系统鲁棒优化_下载链接1](#)

书评

[金融系统鲁棒优化_下载链接1](#)