

不确定条件下多阶段资产负债管理模型



[不确定条件下多阶段资产负债管理模型](#) [下载链接1](#)

著者:金秀

出版者:

出版时间:2008-7

装帧:

isbn:9787505873261

《不确定条件下多阶段资产负债管理模型》从国内外关于银行资产负债管理、保险及养老金计划、长期金融计划问题和多阶段金融资产配置几个方面对资产负债管理的研究进行了归纳总结，针对多阶段资产负债管理问题中的情景生成和随机规划的应用进行了论述。在我国的经济背景下，在对投资者所面临的未来各种资产收益、负债及现金流等不确定性经济因素情景生成基础上，应用数学规划等方法建立以投资者期望财富或成本为目标函数，以投资者的交易环境为约束条件，若干资产、负债等为决策变量的多阶段资产负债管理模型。其中包括适用于不同投资者的多阶段资产负债管理模型；不确定参数的情景生成模型；基于安全增长策略多阶段投资组合模型。结合国内具有负债特征金融投资机构的实际，研究了不确定环境下整合投资策略和负债策略的多阶段资产负债管理问题。《不确定条件下多阶段资产负债管理模型》强调理论与实践相结合，可为这一领域的研究者、投资者提供理论和实践的支持。

作者介绍:

目录:

[不确定条件下多阶段资产负债管理模型](#) [下载链接1](#)

标签

资产管理负债模型

读

评论

[不确定条件下多阶段资产负债管理模型](#) [下载链接1](#)

书评

[不确定条件下多阶段资产负债管理模型](#) [下载链接1](#)