

流动性调整的风险价值模型研究



[流动性调整的风险价值模型研究_下载链接1](#)

著者:林辉

出版者:

出版时间:2009-12

装帧:

isbn:9787305067020

《流动性调整的风险价值模型研究》综合运用风险价值理论、市场微观结构理论、动态优化理论、风险偏好理论、随机过程和统计学等理论方法，将La-VaR模型从单期扩展为多期，从单资产推广到资产组合，由外生性风险拓展为内生性风险，建立了一系列综合地计量市场风险和流动性风险的La-VaR模型。在多期La-VaR模型的研究中，《流动性调整的风险价值模型研究》将确定性等价效用和风险偏好引入模型，通过优化出清策略，得到最优出清轨迹和最优La-VaR，并修正了传统VaR模型基于平方根法则计量多期风险的缺陷。《流动性调整的风险价值模型研究》的研究为VaR找到了更为现实的理论基础，拓展其应用领域，更全面地计量金融资产实际的风险暴露，其研究成果对风险管理具有现实的理论意义和良好的应用价值。

作者介绍:

目录:

[流动性调整的风险价值模型研究_下载链接1](#)

标签

评论

[流动性调整的风险价值模型研究_下载链接1](#)

书评

[流动性调整的风险价值模型研究_下载链接1](#)