

<<全球资产与负债管理建模>>

图书基本信息

书名：<<全球资产与负债管理建模>>

13位ISBN编号：9787505829947

10位ISBN编号：7505829947

出版时间：2003-8

出版时间：经济科学出版社

作者：顾娟 等

页数：700

字数：700000

译者：储海林,顾娟

版权说明：本站所提供下载的PDF图书仅提供预览和简介，请支持正版图书。

更多资源请访问：<http://www.tushu007.com>

<<全球资产与负债管理建模>>

内容概要

本书所探讨的基本主题是：在各种不确定性因素、各种约束条件和履债承诺的条件下，如何进行跨期投资，以取得满意的投资收益。

大多数投资者，无论是个人投资者还是机构投资者，都存在着既不能正确地使投资跨市场多元化，也不能正确地跨时期分配投资的问题。

本书的论文除运用了一些专门的投资方法和对一些投资技巧进行综合之外，还研究了好几类新模型。这些模型既包括正在使用的模型和接近于实用股型，也包括一些创新的模型。

这些模型在不久的将来将可以运用于实践当中。

其中一些论文强调资产 - 负债管理建模的应用前景，这些模型包含个人投资者及各类金融机构（银行、保险公司等）专用的模型。

这些模型实际上就是为个人投资者和机构投资者定制的金融产品，也就是金融工程。

总之，本书对于进行金融市场分析的专业人员而言是一本基本读物。

<<全球资产与负债管理建模>>

书籍目录

丛书总序 中文版序言 致谢 贡献者名单 前言 第一篇 引言 1 长期投资者的资产和负债管理系统：问题的讨论 第二篇 资产配置的状态资产组合分析 2 资产配置决策的重要性 3 最优化资产组合选择的均值、方差和协方差的误差效果 4 做出优异资产配置决策：实践者的指南 第三篇 业绩评价模型 5 业绩及资产持有量归因 6 股票收益的国内及全球影响 7 全球股票及债券模型 第四篇 资产配置的动态资产组合模型 8 判断市场时机：具有通货膨胀调整因子的经验概率估计方法 9 含有衍生资产的多期资产配置 10 国库券期货在策略性资产配置规划中的使用 第五篇 生成元素产生程序 11 随机利率过程的重心近似 12 基于生成元素的金融规划模型的后优化及其在债券资产组合管理中的应用 13 Thwers Perrin 全球资本市场生成元素产生系统 第六篇 货币套期保值及建模技术 14 一种国际资产组合选择和最优化货币套期保值的算法 15 多种货币环境下的最优化保险资产配置 第七篇 资产和负债的动态资产组合分析 16 大学捐赠基金的最优化投资策略 17 允许破产的最优化消费-投资决策：综述 18 运用迭代非聚合对资产-负债管理随机规划模型的求解 19 动态资产-负债管理的CALM随机规划模型 20 定额给付型养老基金资产-负债管理的动态模型 21 不确定性下固定收入证券的资产和负债管理 第八篇 应用资产-负债管理模型的案例分析 22 荷兰养老金计划的资产与负债建模及管理 23 整合的资产-负债管理：应用案例分析 第九篇 总的整合风险管理模型 24 Russell-Yasuda Kasai模型：一种日本保险公司设计的使用多阶段随机规划的资产-负债模型 25 “家庭账户顾问TM”：面向个人投资者的资产和负债管理 译者后记

<<全球资产与负债管理建模>>

版权说明

本站所提供下载的PDF图书仅提供预览和简介，请支持正版图书。

更多资源请访问:<http://www.tushu007.com>