

# 《金融系统鲁棒优化》

## 图书基本信息

书名：《金融系统鲁棒优化》

13位ISBN编号：9787505872257

10位ISBN编号：7505872257

出版时间：2008-6

出版社：经济科学出版社

作者：高莹

页数：126

版权说明：本站所提供下载的PDF图书仅提供预览和简介以及在线试读，请支持正版图书。

更多资源请访问：[www.tushu000.com](http://www.tushu000.com)

# 《金融系统鲁棒优化》

## 内容概要

《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。

# 《金融系统鲁棒优化》

## 作者简介

高莹，博士、副教授、硕士生导师，任教于东北大学工商管理学院。1982年毕业于沈阳工业大学电子工程系，获工学学士学位；1995年毕业于东北大学工商管理学院，获管理学硕士学位，后留校任教；2007年毕业于东北大学工商管理学院，获管理学博士学位。主要研究方向是金融风险管理。主持和参加多项国家、部委和地方的科研课题；曾获辽宁省优秀硕士学位论文指导教师；在国内外重要期刊发表论文十余篇，编著教材3部。

# 《金融系统鲁棒优化》

## 书籍目录

前言第1章 绪论 1.1 金融系统与金融风险 1.2 金融优化 1.3 金融系统的鲁棒性第2章 鲁棒优化方法的理论基础 2.1 鲁棒优化方法的框架和机理 2.2 鲁棒优化方法的若干应用领域 2.3 金融系统中的鲁棒优化模型 2.4 本章小结第3章 基于线性矩阵不等式的投资组合鲁棒优化模型及应用 3.1 线性矩阵不等式 3.2 跟踪误差投资组合优化问题 3.3 基于线性矩阵不等式的跟踪误差投资组合鲁棒优化模型 3.4 模型的应用 3.5 本章小结第4章 具有VaR约束的跟踪误差投资组合鲁棒优化模型及应用 4.1 模型描述 4.2 VaR的计算 4.3 模型的应用 4.4 本章小结第5章 银行卡网络资金运作鲁棒优化模型研究 5.1 网络金融与银行卡网络 5.2 银行卡网络资金鲁棒运作问题 5.3 银行卡网络资金运作鲁棒优化模型 5.4 本章小结第6章 动态金融资产配置鲁棒运作的保成本控制 6.1 鲁棒运作的保成本控制 6.2 动态金融资产配置的保成本控制 6.3 保成本控制的实现 6.4 本章小结第7章 多阶段最坏情景均值-方差鲁棒优化模型及应用 7.1 多阶段情景生成 7.2 多阶段最坏情景均值-方差投资组合选择鲁棒优化模型 7.3 模型的应用 7.4 本章小结总结与展望参考文献致谢

# 《金融系统鲁棒优化》

## 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:[www.tushu000.com](http://www.tushu000.com)