

[首页](#)[概况](#)[研究机构](#)[学者介绍](#)[成果文库](#)[文献数据](#)[培训教育](#)[对外交流](#)

Search the Web

Find It

□ 您的位置： [首页](#) → [数技经济研究杂志](#) → [现实经济问题研究](#)

## VaR方法及其拓展模型在投资组合风险管理中的应用研究

[摘要] 本文在对国外利用VaR方法及其拓展模型对投资组合进行风险管理的理论与方法总结的基础上，建立了符合现阶段中国证券市场实际发展情况的、主要针对市场风险与流动性风险的投资组合风险管理数量模型，并利用1997~2003年的样本数据进行了实证研究，从而为现阶段我国机构投资者的投资组合风险管理提供理论与方法依据。最后指出了进一步研究的方向。

关键词 投资组合 风险管理 市场风险 流动性风险 VaR

地址：北京市建国门内大街5号 邮政编码：100732 电话及传真：010-65125895、010-65137561

版权所有 (c) 中国社会科学院数量经济与技术经济研究所

联系我们 E-mail to: [iqte@cass.org.cn](mailto:iqte@cass.org.cn)