

[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](#)

基于VaR和RAROC的保险基金最优投资研究

【摘要】 本文从保险基金的有效运用所应遵循的安全性、盈利性和流动性的基本原则出发，把VaR、RAROC纳入到保险基金投资的研究中来，建立了一个考虑承保风险、vaR限额约束和追求风险调整的资本收益率最大化的保险基金投资优化模型，并给出了模型的求解方法和计算实例。

关键词 承保风险 保险基金 投资 VaR RAROC

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