系统工程理论与实践　2009 29 (6): 86-93　ISSN: 1000-6788　CN: 11-2267/N

保险资金投资模型及其Markov链模拟

张小茜

收稿日期　修回日期　网络版发布日期　接受日期

摘要　针对保险资金投资的特殊性建立了投资决策的动态模型,并利用近似Markov链计算了数值解. 与经典的Merton模型不同,保险资金投于风险证券的量仅在增资区域中随财富而递增,在控制区域内不会显著增加, 甚至反而可能递减.最后就降息、保险资金现金流与风险证券的相关性、保险公司业绩对最优投资策略的影响进行了敏感性分析.

关键词　保险资金投资　随机现金流　Markov链　HJB方程

分类号

DOI:

对应的英文版文章:2009060086

通讯作者:

作者个人主页: 张小茜

扩展功能

本文信息

Supporting info

PDF(1195KB)

[HTML全文](0KB)

参考文献[PDF]

参考文献

服务与反馈

把本文推荐给朋友

加入我的书架

加入引用管理器

引用本文

Email Alert

相关信息

本刊中 包含“保险资金投资”的相关文章

本文作者相关文章

· 张小茜