ALM

Asset Liability management

Aai\_bl

Asset allocation investment,using Black Litterman model

多资产配置管理流程

1，投资目标：限制，基准

## 多资产配置模型构成

数据{资产数据、时间、研究数据}

指标

策略 {SAA,TAA}

最优化 ： …, 组合调整计划

实施和监控：组合调整安排，可操作{内控、风险、交易等限制}

反馈

### 1，数据{资产数据、时间、研究数据}

{todo：1，gdp growth，M2 growth ；匹配资产回报率和经济增长、货币增长率 }

指标

策略

最优化

可操作{内控、风险、交易等限制}

监控

反馈