

<<风险定量分析>>

图书基本信息

书名：<<风险定量分析>>

13位ISBN编号：9787301188712

10位ISBN编号：7301188714

出版时间：2011-5

出版时间：北京大学

作者：孙立娟

页数：288

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：<http://www.tushu007.com>

## <<风险定量分析>>

### 内容概要

本书以风险的定量分析技术为主线，主要介绍精算风险损失模型及其在保险和金融风险管理中的应用。

《风险定量分析：损失模型及其在保险与金融风险管理中的应用》共分为四个部分，第一部分主要介绍损失的统计估计理论和统计推断方法；第二部分讲述损失的精算模型及随机模拟技术；第三部分主要介绍目前前沿的风险度量方法以及损失模型在信用风险、操作风险中的应用；第四部分介绍风险决策的方法与技术。

## <<风险定量分析>>

### 作者简介

孙立娟，对外经济贸易大学保险学院副教授，博士生导师。

，中国人民大学统计学博士，清华大学数学科学系博士后，台湾"中央研究院"统计科学研究所博士后

。研究方向为：精算学与风险管理、破产理论、生存分析、应用随机过程,从1997年开始从事保险精算的研究和教学工作，在《保险研究》、insurance: mathematics and economics等国内外期刊上发表了多篇文章。

## <<风险定量分析>>

### 书籍目录

#### 第一部分 风险管理基础

第一章 风险模型基础

第二章 损失次数分布

第三章 损失分布

第四章 统计估计理论

第五章 统计推断方法

#### 第二部分 损失模型

第六章 总损失模型

第七章 损失分布的随机模拟

第八章 免赔额与风险保费的计算

第九章 风险过程模型

第十章 破产模型

#### 第三部分 金融风险度量

第十一章 风险度量方法

第十二章 极值理论

第十三章 信用风险度量

第十四章 现代信用风险度量模型

第十五章 操作风险度量

#### 第四部分 风险决策

第十六章 效用理论

第十七章 风险决策理论

附录1 标准正态分布的分布函数表

附录2 巴塞尔新资本协议概述

<<风险定量分析>>

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:<http://www.tushu007.com>