

<<市场风险测度>>

图书基本信息

书名：<<市场风险测度>>

13位ISBN编号：9787509527832

10位ISBN编号：750952783X

出版时间：2011-6

出版时间：中国财政经济出版社一

作者：凯文·多德

页数：449

译者：李雪

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>

## <<市场风险测度>>

### 内容概要

《市场风险测度》系统阐述风险测度的各个环节，用丰富的案例和模型展示各种风险测度方法，介绍市场风险管理方法的新进展和新应用。

## <<市场风险测度>>

### 书籍目录

序言
致谢
第1章 风险值的出现
1.1 金融风险管理的兴起
1.2 市场风险测度
1.3 VaR出现前的风险测度
1.4 风险值
附录 市场风险类型
第2章 金融风险测度
2.1 金融风险测度的均值一方差框架
2.2 风险值
2.3 一致风险测度
2.4 结论
附录1 概率分布函数
附录2 监管中的VaR应用
第3章 市场风险测度的估计：绪论和概述
3.1 数据
3.2 VaR的历史数据模拟估计
.....
第4章 风险测试估计的非参数方法
第5章 波动率、协方差和相关系数的预测
第6章 参考估计（1）
第7章 参数方法（2）：极端值方法
第8章 蒙特卡罗方法
第9章 随机风险测试方法的应用
第10章 期权风险测试估计
第11章 增量风险和成分风险
第12章 持仓到风险因素的映射
第13章 流动性风险估计
第15章 市场风险模型的背后检验
第16章 模型风险
参考文献

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>