第一图书网, tushu007.com

<<市场风险管理策略比较研究>>

图书基本信息

书名：<<市场风险管理策略比较研究>>

13位ISBN编号：9787802212985

10位ISBN编号：7802212987

出版时间：2007-1

出版时间：中国时代经济

作者：李德荃，王汪 著

页数：259

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

第一图书网, tushu007.com

<<市场风险管理策略比较研究>>

内容概要

《市场风险管理策略比较研究》首先为市场风险规定出了一个客观的、可计量的定义，并细致地剖析了市场风险的传导机制。
在引入期望收益一方思维框架的基础上，《市场风险管理策略比较研究》进而比较分析了一些常用的风险管理方法的基本逻辑关系。
微观的说，可以将风险管理策略分为投机性风险管理策略、资产组合风险管理策略、套期保值风险管理策略以及套利风险管理策略等几种类型。
就投机性风险管理策略来说，合理确定风险以及套利风险管理策略等几种类型。
《市场风险管理策略比较研究》专门分析了市场风险管理的效应，并给出了评价特定决策者的市场风险管理效果的基本方法和思路。
《市场风险管理策略比较研究》的基本内容大多涉及相关学术界既有成果，《市场风险管理策略比较研究》作者只是在学习和吸纳这些成果的实践中、在相互切磋的过程中稍有感悟而已。

第一图书网, tushu007.com

<<市场风险管理策略比较研究>>

书籍目录

第1章 市场风险的涵义及其特有属性1.1 市场风险定义综述1.2 市场风险现象的特有属性1.3 市场风险的一般性定义为其数学表达方式第2章 市场风险的传导机制2.1 市场风险对企业法人的影响2.2 市场风险对企业股东的影响第3章 市场风险的测量3.1 风险主观概率分布的定义3.2 风险先验主观概率分布的确定3.3 后验概率分布的确定与贝叶斯学习过程第4章 市场风险的效用4.1 确定性决策环境下效用函数的存在性4.2 风险决策环境的引入4.3 投资者的风险态度第5章 风险管理决策的基本逻辑5.1 风险管理决策的基本属性5.2 风险管理决策的基本逻辑5.3 随机优势决策策略5.4“ 均值一方差 ”不确定性分析框架的引入及其有效性分析第6章“ 期望值一方差分析框架 ”下的资产组合风险管理策略6.1 资产组合均衡价值的确定6.2 风险资产的无套利市场均衡定价模型第7章 金融资产的均衡定价策略7.1 单时期金融市场的局部均衡分析7.2 单时期金融市场的一般均衡分析7.3 离散多期金融市场的局部均衡分析7.4 鞅定价方法第8章 常用投机风险管理决策比较8.1 净现值风险决策分析方法的逻辑8.2 实物期权风险决策分析方法的逻辑8.3 内部收益率风险决策分析方法的逻辑8.4 投资回收期风险决策分析方法的逻辑8.5 上述几种投资决策方法的进一步比较第9章 套期保值与套利风险管理策略比较9.1 套期保值风险管理策略的基本原理9.2 套利风险管理策略的基本原理第10章 风险管理的效应及其业绩的评价10.1 风险管理对策决策人效用的影响10.2 风险管理对企业价值的影响10.3 风险转嫁的效应10.4 风险管理业绩的评估主要参考文献

第一图书网, tushu007.com

<<市场风险管理策略比较研究>>

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