

<<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>