

<<金融资产波动模型与风险度量>>

图书基本信息

书名：<<金融资产波动模型与风险度量>>

13位ISBN编号：9787505868151

10位ISBN编号：7505868152

出版时间：2007-12

出版时间：经济科学出版社

作者：陈守东

页数：282

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>

<<金融资产波动模型与风险度量>>

内容概要

本书从理论与应用两方面入手，深入研究了金融资产波动模型与风险度量，系统、详细地介绍了大量金融中使用的重要数量分析模型与方法，覆盖面广，包括组合投资、资产定价、波动模型和风险管理等常用的模型与方法，并通过大量的实证研究展示了这些模型与方法的使用，部分内容反映了金融领域新的研究成果和前沿的发展。

作者简介

陈守东，男，1955年生，天津市蓟县人。
经济学博士，教授，博士研究生导师。
吉林省第九批有突出贡献中青年专业技术人才和第二批拔尖创新人才工程三层次入选者。
现任教育部人文社会科学百所重点研究基地吉林大学数量经济研究中心副主任。
主持完成和承担了多项国家社会科学基金、教育部人文社会科学重大项目和省部级项目。
在国内外有影响的学术杂志上发表论文50余篇。
多项成果获吉林省社会科学、自然科学优秀成果奖和省优秀教材奖及省部级科技进步奖。

<<金融资产波动模型与风险度量>>

书籍目录

第1章 收益与风险度量 1.1 收益率度量 1.2 均值、方差与相关性度量 1.3 一般风险度量第2章 组合投资与风险分解 2.1 组合投资选择模型 2.2 有效边界的讨论及性质 2.3 组合风险的分解 2.4 基于不同协方差矩阵的风险度量第3章 波动性模型 3.1 ARCH模型 3.2 广义ARCH模型-GARCH模型 3.3 随机波动与条件波动 3.4 上海证券市场分阶段收益率与波动性的实证分析第4章 波动预测与多变量波动模型 4.1 波动预测 4.2 多变量波动模型 4.3 中国股票市场相关性和波动性的二元GARCH模型第5章 风险价值 5.1 VaR的定义及其参数 5.2 VaR与风险管理和资产组合的选择 5.3 VaR的计算方法 5.4 VaR约束下的投资组合选择第6章 基于极值分布的VaR计算模型 6.1 极值理论 6.2 条件自回归在险价值模型 6.3 期望损失模型 6.4 EVT门限选择的模拟研究 6.5 极值理论应用 6.6 基于极值分布理论的VaR与ES度量第7章 期权定价与波动性 7.1 股价变动过程及It定理 7.2 Black—Scholes公式 7.3 灵敏度分析 7.4 波动率分析及估计 7.5 波动率的进一步讨论第8章 度量金融市场风险的Copula方法 8.1 Copula理论及其在金融风险管理中的应用 8.2 市场的协同运动和Copula集合 8.3 Copula度量风险价值的Monte Carlo模拟 8.4 多元Copula理论简介第9章 高频数据波动性 9.1 金融高频数据分析研究的现状 9.2 高频数据分析与建模 9.3 已实现波动参考文献

<<金融资产波动模型与风险度量>>

章节摘录

第1章 收益与风险度量 金融投资的根本目标是取得投资收益，投资收益又总是与风险相伴的，投资者总是不断地在收益与风险之间进行选择，因此，首先需要对收益与风险进行度量。在现代金融投资中，金融资产的收益用其价格相对的变化率度量，金融风险用收益率的方差或标准差度量。金融风险度量的核心是价格波动性的估计和预测。

<<金融资产波动模型与风险度量>>

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>