

<<风险价值VAR>>

图书基本信息

## <<风险价值VAR>>

### 内容概要

经过大幅修订和补充后的最新版本，菲利普·乔瑞关于金融风险管理的最新力作。

本书获得了巨大的成功。

该书最大的优点在于，它异常清晰和深入地解释了各种复杂的问题。

我很乐意地金融界人士和监管者推荐这本书。

该书以朴素的语言，通过细致的、引人入胜的案例分析，揭示了金融灾难发生的根源及从中所获得的经验和训练。

该书非常值得一读。

VAR技术是目前市场上最流行、最为有效的风险管理技术。

本书根据多种模型（参数模型、历史模拟模型），采用大量的金融实例和真实的数据资料，通过量化风险，以朴素的语言重点探讨VAR技术的实际就用，由浅入深地全面介绍了风险价值（VAR）的背景、定义、衡量方法等内容，揭示金融灾难发生的根源及从中所获得的经验和教训。

可以说，本书是各家风险管理机构和个人投资者控制和管理风险的必备武器。

## <<风险价值VAR>>

### 书籍目录

#### 第一部分 背景知识

第1章 风险管理的必要性

第2章 金融风波的教训

第3章 VAR在制定监管资本标准中的应用

#### 第二部分 VAR基础知识

第4章 金融风险的衡量

第5章 风险价值的计算

第6章 VAR模型的回测

第7章 投资组合风险：分析方法

第8章 风险和相关性预测

#### 第三部分 VAR系统

.....

#### 第四部分 风险管理系统的應用

.....

#### 第五部分 风险管理行业

.....

<<风险价值VAR>>

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>