

<<投资与风险管理>>

图书基本信息

书名：<<投资与风险管理>>

13位ISBN编号：9787040195514

10位ISBN编号：7040195518

出版时间：2006-8

出版时间：高等教育出版社

作者：柯晓

页数：211

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>

## <<投资与风险管理>>

### 内容概要

《高等学校金融学专业系列教材：投资与风险管理》主要在于系统性和实用性两方面。一是系统性，《高等学校金融学专业系列教材：投资与风险管理》将系统地介绍定量化投资和风险管理的战略、流程、基础结构。

二是实用性，《高等学校金融学专业系列教材：投资与风险管理》以国内的案例为主，使用的是国内的数据和模型假设，将一步步地引导读者了解如何在国内做定量化投资和风险管理。

《高等学校金融学专业系列教材：投资与风险管理》适合金融界从业人员或高等院校金融专业的学生作为培训或专业课程的教科书，尤其是作为金融工程专业人员的参考书和学生的教科书。

## 作者简介

柯晓，现任南方基金管理公司首席产品设计师，曾任招商证券的首席产品策略师。他作为招商证券基金宝等创新产品的主要设计人员，全程参与了产品开发的各个环节。

在美国留学和工作十载后，柯晓于2002年回国。

他曾在美林证券总部工作五年，担任公司机构客户部的助理副总裁，主管全球股票衍生产品和可转债交易的风险分析，并且为投资银行大客户构造衍生产品。

柯晓是美国纽约大学斯特恩商学院的MBA，在校其间荣获“斯特恩学者”称号。

同时，他也是新泽西州立罗特格斯大学的理科硕士，目前仍是其计算机科学系的博士候选人，以及美国商学院荣誉社会BETA、GAMMA和SIGMA的终生会员。

## <<投资与风险管理>>

### 书籍目录

第1篇 基础知识第1章 风险、收益的分布第2章 金融产品的基础知识介绍第2篇 投资入门第3章 自下而上的投资模型第4章 自上而下的投资模型第5章 行业配置模型第6章 风险模型简介第7章 绩效评估模型第3篇 风险管理入门第8章 投资组合的风险第9章 波动性和相关性预测第10章 测量VaR的方法简介第11章 蒙特卡罗法第12章 回验测试、压力测试和情景分析第13章 风险分析和报告第4篇 投资和风险管理的应用和未来第14章 海内外资产管理产品第15章 新产品的开发第16章 投资和风险管理的未来主要参考文献  
教学软件索取单

<<投资与风险管理>>

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>