

<<金融市场风险定量分析>>

图书基本信息

书名：<<金融市场风险定量分析>>

13位ISBN编号：9787802069046

10位ISBN编号：7802069041

出版时间：2010-3

出版时间：光明日报出版社

作者：柯金川 著

页数：248

字数：200000

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>

<<金融市场风险定量分析>>

内容概要

本书从定量的角度来度量金融市场风险，主要内容包括证券市场时间序列分析、优化金融理论和金融风险评价等篇章。

每章都以经济模型为基础，结合实际案例和数据进行应用性实证分析。

<<金融市场风险定量分析>>

书籍目录

第一篇 证券市场时间序列分析

第一章 股市波动的自回归特征分析

§ 1.1 引言

§ 1.2 模型概述

§ 1.3 实证分析

第二章 基于R / S模型的股票收益与波动率分析

§ 2.1 引言

§ 2.2 R / S分析法

§ 2.3 实证研究

§ 2.4 结论

第三章 协整方法及其在金融市场中的应用

§ 3.1 引言

§ 3.2 协整理论

§ 3.3 协整理论在证券投资中的实证研究

§ 3.4 国际资本流动运行分析

第二篇 优化金融学理论

第四章 神经网络模型在股价预测中的应用

§ 4.1 人工神经网络概述

§ 4.2 BP神经网络

§ 4.3 BP神经网络预测模型的实证分析

§ 4.4 小结

第五章 基于DEA方法的投资组合优化

§ 5.1 引言

§ 5.2 DEA模型

§ 5.3 基于DEA方法的投资组合优化

§ 5.4 DEA模型的应用

第三篇 金融风险评价

参考文献

<<金融市场风险定量分析>>

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>