

<<证券市场风险测度>>

图书基本信息

书名：<<证券市场风险测度>>

13位ISBN编号：9787810986106

10位ISBN编号：7810986104

出版时间：2006-5

出版时间：上海财经大学

作者：王明涛

页数：297

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>

## <<证券市场风险测度>>

### 内容概要

《证券市场风险测度：管理模型研究》首先对证券市场风险的基本概念进行了研究；其次，在对现有理论及研究成果进行总结与评价的基础上，设计了新的证券市场风险计量指标，并研究了基于新风险测度指标的证券组合优化模型及其求解方法；再次，研究了产生证券市场风险的因子，并建立市场风险与风险因子的关系模型；最后，通过实证分析验证了理论的正确性，并提出相应建议，为管理层监管和控制证券市场风险提供了有益的参考。

《证券市场风险测度：管理模型研究》是现有证券市场风险理论研究的继续，是对现阶段证券市场风险测度及管理中存在问题的进一步研究，相信它对人们更深刻地计算与管理证券市场风险有所帮助。

## <<证券市场风险测度>>

### 书籍目录

序言引言1 研究背景及问题的提出2 研究目标、内容与方法3 研究框架1 证券市场风险的基本概念研究1.1 风险的基本概念及其本质属性1.2 证券市场风险的基本概念1.3 影响证券市场风险的主要因素分析2 证券市场风险计量、管理理论评述2.1 证券市场风险的计量理论评述2.2 证券市场风险计量理论的总体评价及存在的问题2.3 证券市场风险管理研究现状分析3 证券市场风险新的计量理论研究3.1 设计风险计量指标应遵循的原则3.2 证券市场风险负面性的描述与计量3.3 证券市场风险新计量指标的设计与估计3.4 证券市场风险定性指标的设计与估计3.5 证券市场风险的系统指标设计与估计3.6 证券组合投资风险计量研究3.7 新旧风险计量指标的比较研究——理论分析4 基于新风险计量指标体系的证券组合优化模型4.1 模型的基本假设4.2 基于新风险计量指标的证券组合投资优化模型的各种形式4.3 证券组合优化模型的求解方法研究4.4 下偏矩证券组合优化模型的转换形式5 我国证券市场风险因子分析5.1 影响我国证券市场风险的主要因子5.2 主要风险因子对我国证券市场风险的影响机理分析6 我国证券市场风险管理模型研究6.1 研究的基本思路及使用的计量经济学模型6.2 风险的计量6.3 宏观经济环境因素对风险的影响分析6.4 上市公司因素对证券市场风险影响的实证研究6.5 政策因素对证券市场风险影响的实证研究6.6 机构对证券市场风险的影响6.7 总体因素对证券市场风险的影响7 基于新风险计量指标的实证研究7.1 引言7.2 基于新风险计量指标的证券组合投资优化模型实证研究7.3 基于新风险计量指标的证券市场风险性实证研究8 结论与政策建议8.1 主要结论8.2 主要创新8.3 政策建议8.4 进一步研究的问题附录1 有关定理的证明附录2 原始数据附录3 相关程序参考文献

<<证券市场风险测度>>

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>