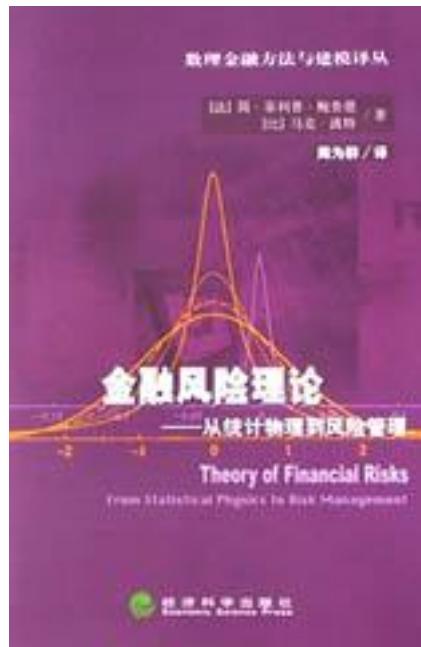


# 金融风险理论



[金融风险理论 下载链接1](#)

著者:简 · 菲利普 · 鲍查德

出版者:经济科学出版社

出版时间:2002-8

装帧:平装

isbn:9787505828056

《金融风险理论:从统计物理到风险管理》的重点是金融风险的控制和管理,为此必须要有可管、可控的指标,有了这些指标,就可以对风险定价,给出合理的模式和方法,所以本书的最后一章,广泛讨论了各种期权的定价和风险管理。这是一本视角、方法都很有特点的书,自始至终贯穿着用实际的证券市场的数据来说明、验证相应的分析结论,用股票市场的指数、外汇市场的交易和国债市场的行情作为实例,因此是有数据支持,令人不感到枯燥的分析。各种不同观点的人,从这本书的分析中都会有所收获。

作者介绍:

目录: 丛书总序  
中文版序言  
原版序言  
原版前言  
作者简介  
1 概率理论: 基本概念  
2 实际价格统计学  
3 极端风险和最优投资组合  
4 期货和期权: 基础概念  
5 期权: 一些专题  
金融术语简明汇编  
符号索引  
索引  
译者后记  
· · · · · (收起)

[金融风险理论 下载链接1](#)

## 标签

金融

统计物理

风险管理

投资

Finance

小布的数理学

金融风险

风险度量

## 评论

太难了，贼鸡儿难！买回家看！要学统计物理！

---

高深啊 高深

---

难度很高的一本书，有很多东西没读懂，呵呵；物理学很强大……

---

[金融风险理论 下载链接1](#)

## 书评

两位作者都是金融物理学领域的先锋人物，本书中他们以实际数据对传统金融风险度量理论进行了深入剖析，进而得出了一些不同的结论。从统计意义上标示了风险的真实内涵，我并不能确定这种结论在多大范围内是有效的，但可以肯定的是，对于金融风险度量这个我们所知甚少的湖泊，这...

---

[金融风险理论 下载链接1](#)