

金融高阶矩风险识别与控制



[金融高阶矩风险识别与控制_下载链接1](#)

著者:许启发

出版者:第1版 (2007年2月1日)

出版时间:2007-2

装帧:平装

isbn:9787302142799

本书系统地讨论了矩序列风险的形成、表现、测试、规避等一系列理论与实际问题，在建模理论与建模方法研究的基础上，进一步形成金融动态风险的识别与控制方案，一方面可以为在高阶矩风险方面的进一步研究提供理论基础，为带有高阶矩风险的动态组合投资、动态资产定价等相关主题研究提供理论依据与技术支持；另一方面，动态风险识别与控制方案可以为全国金融决策机构、投资决策机构、基金管理机构进行风险识别、进行组合投资规避金融风险的动态影响提供一套工具和方法。

作者介绍:

目录:

[金融高阶矩风险识别与控制_下载链接1](#)

标签

金融

评论

作者的论文集罢.拿两市做了点分数维实证,不清楚国内做这方面的人多不...讨论高阶矩的内容不多,没有提到什么市场意义.

[金融高阶矩风险识别与控制_下载链接1](#)

书评

[金融高阶矩风险识别与控制_下载链接1](#)