

投资与风险管理



[投资与风险管理_下载链接1](#)

著者:柯晓

出版者:

出版时间:2006-8

装帧:

isbn:9787040195514

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

作者介绍:

目录:

[投资与风险管理_下载链接1_](#)

标签

评论

[投资与风险管理_下载链接1](#)

书评

[投资与风险管理_下载链接1](#)