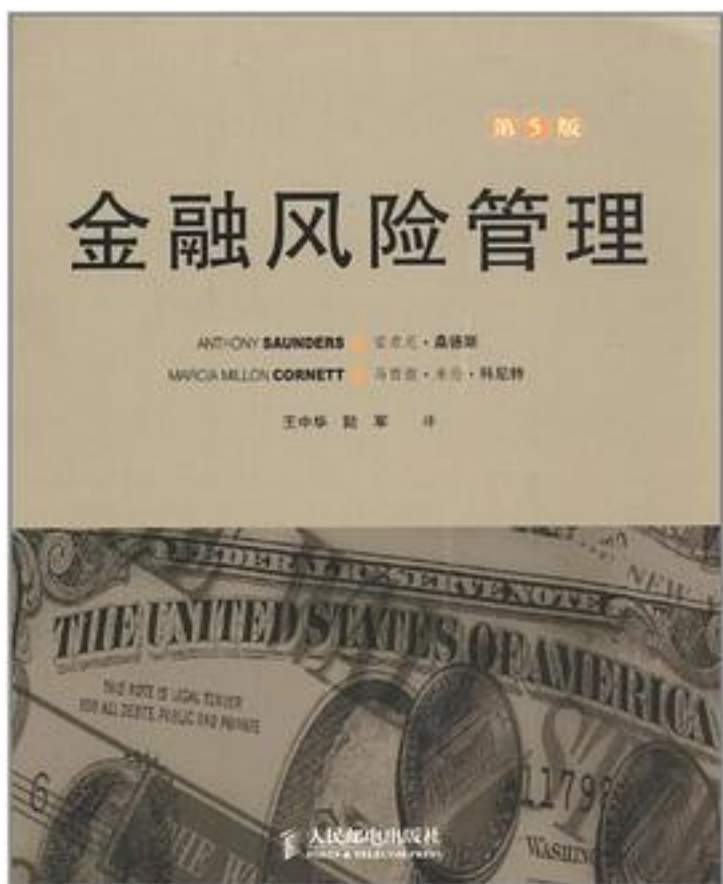


金融风险管管理



[金融风险管管理_下载链接1](#)

著者:彼得·F·克里斯托弗森

出版者:中国人民大学出版社

出版时间:2015-8

装帧:平装

isbn:9787300212104

自从金融市场产生以来，金融风险就如影随形地伴随而生了，金融风险管理也就成为金融管理中的核心内容。《金融风险管理(第二版)》从金融风险管理的模型和技术角度，对金融风险管理进行了深入分析。全书共分为四个部分：第一部分介绍了一些金融风险管理的基础理论和知识；第二部分讨论了单变量风险模型；第三部分则阐述了多变量风险模型；第四部分介绍了风险管理方面的一些深入话题。

《金融风险管理(第二版)》具有以下几个方面的特色：一是，内容自成体系，紧扣金融风险管理技术和模型的主线；二是行文和表达深入浅出，对金融风险管理的技术和模型讲解得非常透彻，对于想深入学习的读者来说，可以获得足够的相关知识，而对于只想简单了解的读者来说，略过那些较深的技术性内容，也可以几乎毫无障碍地学到需要的知识；三是，很好地将理论和实践结合起来，在每一章的结尾都有基于Excel的实证练习，让读者可以在练习的过程中更好地掌握相应的理论和模型知识。

《金融风险管理(第二版)》适用的读者范围比较广，不仅适用于金融、经济、管理等专业高年级本科生、硕士生甚至博士生教学和参考，也适用于MBA学生的相关课程，而对于金融业及相关行业的实务工作者，《金融风险管理(第二版)》也不失为一本有较高价值的参考书。

作者介绍:

彼得·F·克里斯托弗森 (Peter F.Christoffersen)，宾夕法尼亚大学经济学博士，目前是多伦多大学金融学教授。

目录: 第一部分 背景

第1章 风险管理和金融收益

1 本章概要

2 学习目标

3 风险管理及其企业

4 简单的风险分类法

5 资产收益的定义

6 资产收益的典型事例

7 资产收益的一般模型

8 从资产价格到资产组合收益

9 VaR的风险度量介绍

10 本书概览

第2章 历史模拟、风险值和期望损失

1 本章概要

2 历史模拟

3 权重化的历史模拟

4 从2008—2009年危机中所得的实证

5 打破HSVaR的真实概率

6 带有极端覆盖率的VaR

7 期望损失

8 总结

第3章 金融时间序列分析基础

1 本章概要

2 概率分布和统计量

3 线性模型

4 一元时间序列模型

5 多元时间序列模型

6 总结

第二部分 一元风险模型

第4章 日数据的波动性建模

1 本章概要

2 简单的方差预测

3 GARCH方差模型

4 极大似然估计

5 GARCH模型的扩展

6 方差模型估计

7 总结

第5章 基于日内数据的波动性模型

1 本章概要

2 已实现方差：四个基本案例

3 预测已实现方差

4 已实现方差的构建

5 数据问题

6 基于极差的波动性模型

7 再次评估GARCH方差预测估计

8 总结

第6章 非正态分布

1 本章概要

2 学习目标

3 使用QQ图可视化非正态分布

4 滤波历史模拟方法

5 对于Var的CornishFisher近似

6 标准t分布

7 非对称t分布

8 极值理论

9 总结

第三部分 多元风险模型

第7章 协方差和相关关系模型

1 本章概要

2 资产组合方差和协方差

3 动态条件相关性 (DCC)

4 从日内数据估计日协方差

5 总结

第8章 风险期限结构的模拟

1 本章概要

2 一元模型中的风险期限结构

3 常数相关性的风险期限结构

4 动态相关性的风险期限结构

5 总结

第9章 集成风险管理的分布和copulas模型

1 本章概要

2 阈值相关性

3 多元分布

4 Copula模型方法

5 使用copula模型的风险管理

6 总结

第四部分 风险管理的进一步讨论

第10章 期权定价

1 本章概要

2 基本定义

3 使用二叉树为期权定价

4 在正态分布下的期权定价

5 考虑偏度和峰度

6 考虑动态波动性

7 隐含波动性方程 (IVF) 模型

8 总结

第11章 期权风险管理

1 本章概要

2 期权的delta

- 3 应用delta的资产组合风险
- 4 期权gamma
- 5 使用gamma的资产组合风险
- 6 使用完全估值法的资产组合风险
- 7 一个简单的例子
- 8 Delta和gamma方法的缺点
- 9 总结
- 第12章 信用风险管理
 - 1 本章概要
 - 2 公司违约历史概述
 - 3 公司违约建模
 - 4 资产组合的信用风险
 - 5 信用风险的其他方面
 - 6 总结
- 第13章 事后检验和压力测试
 - 1 本章概要
 - 2 后验VaR
 - 3 增加信息集
 - 4 预期损失的后验测试
 - 5 全部分布的后验测试
 - 6 压力测试
 - 7 总结
- 译后记
 - • • • • ([收起](#))

[金融风险管理 下载链接1](#)

标签

金融风险管理

金融

金融工程

期权

亲爱的必修课

财务金融

评论

原书是好书，但译者实在太差劲了，语句不懂润色，专业名词也翻得不符合国人使用习惯，感觉自己在看百度翻译。

实在忍不住吐槽了，这是我见过的最辣鸡的翻译，这是拿机器翻的吧，我读原版都没有读中文版这么心累，大概这三位译者连英语四级都没过呢。这出版社也是够了，连审核都不审的吗，第一章至少有5个翻译/公式错误。强烈建议读原版！别交智商税了

这本书别的跟常见的计量统计很接近，是好书，不过在27页讲VaR一节的关键推导一直看不懂，这个应该是跟金融风险常见指标最最相关的知识了，希望有人能够解答下。

[金融风险管理_下载链接1](#)

书评

[金融风险管理_下载链接1](#)