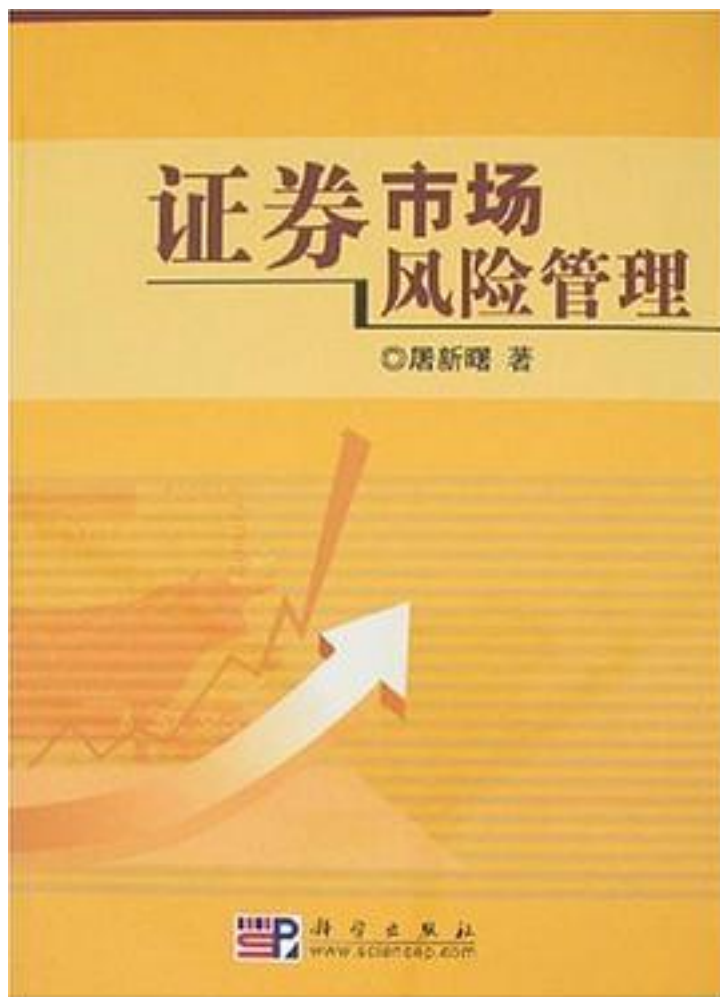


证券市场风险管理



[证券市场风险管理_下载链接1](#)

著者:屠新曙

出版者:科学

出版时间:2008-1

装帧:

isbn:9787030205797

《证券市场风险管理》首先介绍了证券市场的相关基本知识以及证券的收益与风险度量方法；然后重点论述了国内外学者以及作者自己在有关证券组合分析理论方面的相关研

究；接下来介绍了证券定价理论、证券投资业绩评价方法以及作者在这方面的相关实证研究；在完成对这些常规理论的论述后，《证券市场风险管理》在最后三章分别介绍作者提出的风险评级方法及其实证研究、用非参数高阶谱分析方法对风险传导的实证研究、时变风险度量模型，这三章没有任何可借鉴的文献，完全是作者根据自己对问题的不断思考与探索得出的研究成果。在所有章节中，最富有创造性的内容当属时变风险度量模型，该模型给出的风险是一个随时间变化的量，不是一个常量，这与人们对风险的感性认识是一致的，因此它对实践具有重大的指导意义。由于时变风险是作者独立提出的一个从形式到内容都全新的风险度量方法，因此由它可以重新构建证券风险的分析框架。

《证券市场风险管理》可供经济、金融、会计和其他管理类学科的教师、研究人员、高年级本科生和研究生、证券从业人员和金融监管人员等阅读参考。

作者介绍:

目录:

[证券市场风险管理_下载链接1](#)

标签

评论

[证券市场风险管理_下载链接1](#)

书评

[证券市场风险管理_下载链接1](#)