

# Copula理论及其在金融分析上的应用



[Copula理论及其在金融分析上的应用\\_下载链接1](#)

著者:

出版者:

出版时间:2008-8

装帧:

isbn:9787302179122

《Copula理论及其在金融分析上的应用》对Copula理论和方法进行了系统的介绍，特别是针对中国金融市场的应用做了大量的实证工作，有利于加深读者对Copula理论、方法及其应用的理解。全书共分五章，第一章介绍Copula函数的定义、基本性质和相

关理论，讨论基于Copula理论的一致性和相关性测度，探讨常用的几Copula函数的基本性质及其在金融分析中的应用。第2章详细讨论Copula理论在多变量时间序列模型（包括Copula-GARCH类模型和Copula-SV类模型）的构建、估计和检验等问题，研究中国股市的相关模式和相关结构。第3章和第4章讨论时变相关Copula模型和变结构Copula模型的建模方法 and 应用特点，研究中国股市动态相关性和变结构特点。第5章讨论Copula理论的仿真技术及其投资组合风险分析问题，包括多元正态Copula、t-Copula和多元阿基米德Copula函数的仿真技术以及相应的投资组合风实证分析，Copula模型在金融波动溢出分析和信用风险分析中的应用。

作者介绍:

目录:

[Copula理论及其在金融分析上的应用\\_下载链接1](#)

## 标签

copula

金融

统计

数学

商业-金融-统计

时间序列

Time\_Series

## 评论

读完感觉作者的水平在国内很高了，就是数据用的太老。96-02年的市场不完善。

-----  
只读过第一章，看信用相关内容时过的，可能是时间序列里头的信用吧。

-----  
对于数学基础一般的人来看，还可以

-----  
Copula算时序理论里面小众的研究方向。自从David X. Li被认为在华尔街搞了事情之后，好像这个方向就丧失热度了。不过不管怎么说，这个理论本身还是很巧妙的。

-----  
[Copula理论及其在金融分析上的应用\\_下载链接1](#)

书评

-----  
[Copula理论及其在金融分析上的应用\\_下载链接1](#)