

# 《基于典型事实的金融市场动态极值风险》

## 图书基本信息

书名：《基于典型事实的金融市场动态极值风险测度与传导效应研究》

13位ISBN编号：9787030361547

10位ISBN编号：7030361547

出版时间：2013-1

作者：林宇，陈王

页数：123

版权说明：本站所提供下载的PDF图书仅提供预览和简介以及在线试读，请支持正版图书。

更多资源请访问：[www.tushu000.com](http://www.tushu000.com)

# 《基于典型事实的金融市场动态极值风险》

## 内容概要

《编著者基于典型事实的金融市场动态极值风险测度与传导效应研究》编著者林宇等。

《编著者基于典型事实的金融市场动态极值风险测度与传导效应研究》的研究建立在“金融市场并非完全有效”的假设基础之上，运用数理统计分析、实证对比研究方法与计算机技术，提取出金融市场收益与波动率所呈现的典型事实的经验证据，对发生概率小、一旦发生就会引发金融市场剧烈动荡，使投资者遭受巨大损失的极值风险进行数理建模，并通过实证对比，筛选出具有最佳风险测度能力的模型，进而探索出中国大陆市场与部分国际市场等不同市场之间极值风险的传导效应，力求清晰地展示出极值风险在不同市场之间的传导关系图。

本书为金融市场风险管理领域的专业著作，语言浅显易懂，知识层层递进，思想逐渐深入，可供高等院校金融类专业的本科生和研究生学习使用，也可供相关科研工作者、从事金融工作的专业人员及政府相关部门参考。

# 《基于典型事实的金融市场动态极值风险》

## 版权说明

本站所提供下载的PDF图书仅提供预览和简介，请支持正版图书。

更多资源请访问:[www.tushu000.com](http://www.tushu000.com)