

《风险统计与决策分析》

图书基本信息

书名：《风险统计与决策分析》

13位ISBN编号：9787801187963

10位ISBN编号：7801187962

出版时间：1999-06

出版社：经济管理出版社

作者：严武,等

页数：326

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

书籍目录

目录

1风险的辨识

- 1.1 风险的定义与分类
- 1.2 风险辨识的基本方法
- 1.3 风险辨识的障碍

2概率分布与风险估计

- 2.1 概率分布与风险度
- 2.2 主观概率与客观概率
- 2.3 风险估计的几种方法
- 2.4 风险影响分析

3抽样风险、检验风险与判别风险

- 3.1 抽样分布
- 3.2 抽样估计方法及其数理基础
- 3.3 总体目标量的估计技术
- 3.4 抽样风险
- 3.5 假设检验的基本思想及其步骤
- 3.6 总体参数的假设检验
- 3.7 假设检验的风险
- 3.8 风险判别分析

4期望货币损益值准则与风险决策模型

- 4.1 风险型决策的基本要素
- 4.2 期望损益决策准则
- 4.3 增量分析模型
- 4.4 决策树模型
- 4.5 矩阵决策模型
- 4.6 部分期望决策模型
- 4.7 模型模拟方法
- 4.8 敏感性分析
- 4.9 决策分析的“软”技术

5抽样信息与贝叶斯决策分析

- 5.1 先验分布
- 5.2 贝叶斯定理与后验分析
- 5.3 决策法则
- 5.4 风险函数、贝叶斯风险和贝叶斯原则
- 5.5 反序分析

6风险型决策与效用准则

- 6.1 期望货币损益值准则的局限
- 6.2 效用决策理论与分析方法
- 6.3 效用函数及其构造方法
- 6.4 效用决策模式

7风险型动态决策

- 7.1 马尔可夫风险动态决策的基本理论
- 7.2 马尔可夫风险动态决策的应用
- 7.3 多阶段动态决策的基本理论
- 7.4 风险型多阶段动态决策

8风险型竞争性决策

- 8.1 竞争性决策的基本理论

8.2 风险型竞争性决策分析

9 模糊风险决策

9.1 模糊数学的基本理论

9.2 模糊聚类分析

9.3 模糊风险综合评价决策

10 风险分析中若干问题的讨论

10.1 两种风险统计决策评价模型的比较分析

10.2 证券投资组合风险分析

10.3 股票市场季节性波动风险分析

10.4 金融风险分析的VAR技术

主要参考目录

《风险统计与决策分析》

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