金融市场多标度理论建模及其风险管理应用



作者: 杨宏林编

出版社:长沙:湖南大学出版社

出版日期: 2011.06

总页数: 126

介绍:本书通过对金融市场多标度统计分布、临界标度、相关性和层次结构等行为特征的准确刻画,发掘隐含于金融市场多标度条件下波动的内在结构和微观机理,获得多标度波动级串间的传递方向和关联特征;设计基元分割概率和随机分割数等控制参量来涵盖多标度特征,构建离散多标度波动随机级串模型,进而计算多标度波动矩和协方差阵,研究资产多标度风险度量和控制;并将研究成果应用到多标度风险度量和投资组合优化领域,促进金融市场波动建模理论和风险管理实践的创新与发展。

说明: 登录教客网 (https://www.jiaokey.com/book/detail/12839545.html) 查找全本阅读方式

金融市场多标度理论建模及其风险管理应用 评论地址: https://www.jiaokey.com/book/detail/12839545.html

教客网提供千万本图书阅读地址。

https://www.jiaokey.com/book/detail/12839545.html

书名: 金融市场多标度理论建模及其风险管理应用