基于关联网络的系统性风险度量方法及其应用



作者: 苏木亚著

出版社:北京:中国经济出版社

出版日期: 2017.04

总页数: 250

介绍:本专著以关联网络的相关模型和方法为基本工具,结合经典金融计量模型,主要研究系统性风险的传染特征。本专著包含五篇共十五章内容。第一章和第二章组成基础篇,其中第一章是绪论部分,主要阐述本书的选题背景和研究意义,第二章是预备知识,主要介绍下文的实证过程中用到的模型和方法。第三章至第七章组成第二篇,主要利用关联网络模型研究全球股市间的风险传染问题。第八章至第十章组成第三篇,主要借助关联网络分析全球主要股市对我国股市的波动溢出效应。第十一章至第十三章组成第四篇,主要从关联网络视角出发刻画我国股市的波动溢出效应和股市

说明: 登录教客网(https://www.jiaokey.com/book/detail/14241904.html) 查找全本阅读方式

基于关联网络的系统性风险度量方法及其应用 评论地址: https://www.jiaokey.com/book/detail/14241904.html

教客网提供千万本图书阅读地址。

https://www.jiaokey.com/book/detail/14241904.html

书名:基于关联网络的系统性风险度量方法及其应用