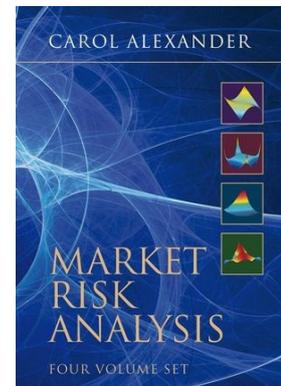


[BUSINESS & ECONOMICS/Finance]

市場リスク分析 (全4巻) Market Risk Analysis

Carol Alexander: ISMA, University of Reading



本書について

市場リスク分析に関するさまざまなトピックを、詳細かつ包括的に解説する。関連項目間の相互参照により、読みながら自然と知識と関心領域を広げることができる。金融界の実務家、研究者、学生に最適な参考図書。

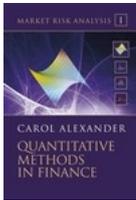
出版: 2009年1月

ISBN13: 978-0-470-99799-4

ページ数(約): 1,652(全4巻)

価格: US\$290.00 (2009年12月現在/変動あり)

各巻明細



Volume I: Quantitative Methods in Finance

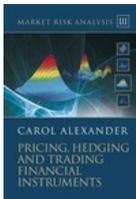
ISBN13: 978-0-470-99800-7 価格: US\$65.00

以降の巻を正しく理解するために必要な数学的・金融論的基礎を扱う。微積分学、線形代数学、確率・統計学、数量的手法、ポートフォリオ数学などを取り上げ、市場リスク分析に関わる主要な概念を分かりやすく解説する。金融論の修士レベルの教科書として最適。

Volume II: Practical Financial Econometrics

ISBN13: 978-0-470-99801-4 価格: US\$80.00

金融計量経済学を、アセットプライシング、ファンドマネジメント、市場リスク分析への応用を含めて詳細に論じる。バーラ・モデル、トラッキングエラー、主成分分析、ボラティリティと相関、GARCHモデル、共和分、マルコフ・スイッチング・モデル、離散選択モデル、非線形回帰などの概念を取り上げる。



Volume III: Pricing, Hedging and Trading Financial Instruments

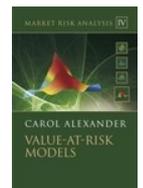
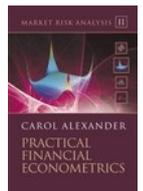
ISBN13: 978-0-470-99789-5 価格: US\$100.00

債券とスワップのプライシング、ヘッジング、トレーディング、先物、オプションとボラティリティなどを論じる。インタラクティブなExcelスプレッドシートの形にまとめた数値例も付録のCD-ROMに収録し、理解を助ける。

Volume IV: Value at Risk Models

ISBN13: 978-0-470-99788-8 価格: US\$100.00

Value At Risk (VaR)に焦点を当て、類書では見られないほど詳細に解説する。他の巻と同様に、数値例のExcelファイルを取めたCD-ROMが付録となっており、さまざまなシミュレーションを実際に試すことができる。



◆ご注文は洋書店にお願いします

◆資料ご請求、ご質問は—— **ワイリー・ジャパン**

〒112-0002東京都文京区小石川1-28-1

フロンティア小石川ビル4F

TEL 03-3830-1232 FAX 03-5689-7276

E-mail: marketing@wiley.co.jp

日本語ホームページ: www.wiley.co.jp

取扱書店