

综述

金融风险度量方法的研究进展

王燕,杨文瀚

河海大学商学院,南京航空航天大学经济与管理学院 江苏南京210098

收稿日期 修回日期 网络版发布日期 接受日期

摘要 风险管理是金融业的主要任务之一,而金融风险度量则是风险管理的重中之重。风险度量方法选择的合理与否决定着风险管理的成败。简要回顾了风险度量发展过程,并对主要的风险度量方法进行分析,指出其优点和不足;最后,分析了风险度量方法的未来发展趋势。

关键词 [金融](#) [风险度量](#) [方差](#) [VaR](#) [熵](#) [行为金融](#)

分类号

DOI:

对应的英文版文章: [2005-08-071](#)

通讯作者:

王燕

作者个人主页: 王燕;杨文瀚

扩展功能

本文信息

- ▶ [Supporting info](#)
- ▶ [\[PDF全文\]](#)(223KB)
- ▶ [\[HTML\]](#)(OKB)
- ▶ [参考文献\[PDF\]](#)
- ▶ [参考文献](#)

服务与反馈

- ▶ [把本文推荐给朋友](#)
- ▶ [加入我的书架](#)
- ▶ [加入引用管理器](#)
- ▶ [引用本文](#)
- ▶ [Email Alert](#)
- ▶ [文章反馈](#)
- ▶ [浏览反馈信息](#)

相关信息

- ▶ [本刊中 包含“金融”的 相关文章](#)
- ▶ 本文作者相关文章
 - [王燕](#)
 - [杨文瀚](#)

