

# 《金融指数产品创新及其风险控制研究——上海财经大学应用统计研究中心系列丛书》

## 书籍信息

版次：1

页数：322

字数：256000

印刷时间：2005年05月01日

开本：

纸张：胶版纸

包装：平装

是否套装：否

国际标准书号ISBN：9787810983600

丛书名：上海财经大学应用统计研究中心系列丛书

## 内容简介

本书在研究方法上采用定性与定量研究相结合的方式。在定性研究方面，本书遍历了欧美等发达市场以及亚洲等新兴市场的主要指数创新产品的产品设计和风险控制方法，采用归纳法总结其共性与个性，作为我国指数编制及其产品创新的镜鉴；在指数期权产品设计中又采用了对比研究的方法。在定量研究方面，本书采用了事件研究法、VaR方法、EWMA方法、极值理论、GARCH模型、最小方差模型、均值方差模型、CAPM模型等，确定出适合我国证券市场的指数创新产品合约规格并提出风险控制措施，研究了如何从技术上量化风险并从制度上控制风险，弥补了国内在股票指数产品创新研究中缺乏系统性研究的空白。研究所提出的股票指数创新产品的可操作性建议，可以作为交易和中国证监会等证券监管部门制定决策的重要依据。

本书的研究成果进一步完善了我国统计指数编制的理论和方法，丰富了我国统计指数理论和应用的宝库，拓展了统计定量分析方法在金融行业的应用领域，其研究成果可充实到我国统计以及金融统计的教材中。

## 作者简介

徐国祥，男，汉族，1960年3月16日出生，经济学博士，1995年至2003年4月曾任上海财经大学统计学系主任、教授、博士生导师，现任上海财经大学应用统计研究中心主任、教授、博士生导师，财政部跨世纪学科带头人，上海市曙光学者。兼任国际统计学会会员、中国统计学会常务理事

## 目录

### 前言

### 第一章 股票价格指数

#### 第一节 国外证券市场股价指数评析

##### 一 道琼斯股价指数系列

##### 二 标准普尔股价指数系列

##### 三 摩根斯坦利资本国际股价指数系列

##### 四 富时股价指数系列

##### 五 其他国际著名股价指数

##### 六 国际股价指数的共性分析

#### 第二节 我国证券市场股价指数

##### 一 上海证券交易所股价指数

##### 二 深圳证券交易所股份指数

##### 三 其他股价指数

### 第三节 我国统一股价指数编制研究

#### 一 指数期货标的指数编制的基本原则

#### 二 我国主要股票指数缺陷分析

#### 三 指数期货标的指数编制研究及其实证分析

#### 四 研究结论

## 第二章 债券价格指数

### 第一节 债券价格指数编制的意义

### 第二节 国际著名债券价格指数

#### 一 美林债券指数系列

#### 二 JP摩根债券指数系列

#### 三 道琼斯公司债券指数系列

#### 四 摩根斯坦利资本国际指数系列

#### 五 HSBC债券指数系列

#### 六 国外其他债券指数系列

#### 七 各国债券指数的共性分析

### 第三节 我国证券市场债券价格指数实证研究

#### 一 上海证券交易所债券种类、规模与特点

#### 二 我国证券市场债券价格指数的编制方法

#### 三 我国证券市场国债价格指数的实证分析

#### 四 全收益国债指数和净价债券的比较

#### 五 国债指数与其他证券价格指数的相关性

#### 六 债券指数的其他相关统计指标

## 第三章 证券投资基金价格指数

### 第一节 证券投资基金价格指数编制的意义

### 第二节 证券投资基金价格指数的编制方法

.....

## 第四章 国际市场金融指数产品创新评析

## 第五章 我国股价指数产品创新的可行性分析与策略研究

## 第六章 我国股价指数产品创新及其风险控制

## 参考文献

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.tushupdf.com](http://www.tushupdf.com)