

<<金融指数产品创新及其风险控制研究>>

图书基本信息

书名：<<金融指数产品创新及其风险控制研究>>

13位ISBN编号：9787810983600

10位ISBN编号：7810983601

出版时间：2005-5

出版时间：上海财经大学出版社

作者：徐国祥 吴泽智

版权说明：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：<http://www.tushu007.com>

## 内容概要

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。

书籍目录

前言第一章  
股票价格指数  
第

版权说明

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:<http://www.tushu007.com>