

<<金融统计学>>

图书基本信息

书名：<<金融统计学>>

13位ISBN编号：9787543216808

10位ISBN编号：7543216809

出版时间：2009-12

出版时间：格致出版社

作者：徐国祥

页数：351

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>

<<金融统计学>>

内容概要

本书按照我国金融体系的运行现状和特点，运用各种统计方法对我国金融中的理论问题和现实问题作了翔实的分析和研究。

主要阐述货币市场和资本市场统计、有价证券的价值分析、通货膨胀的统计、外债监测统计指标体系、证券价格指数体系、证券投资组合研究、VaR模型及其实证分析、金融高频数据及其实证分析、金融风险预警指标体系及其预警方法等。

<<金融统计学>>

作者简介

徐国祥，男，经济学博士，上海财经大学应用统计研究中心主任、教授、博士生导师，曾任上海财经大学统计学系系主任。

获财政部跨世纪学科带头人、上海市曙光学者和曙光跟踪学者、上海市优秀青年教师、国家统计局全国优秀统计教师、宝钢教育基金理事会全国优秀教师、教育部

<<金融统计学>>

书籍目录

第1章 金融统计理论和方法综述 第一节 金融与金融体系 第二节 金融统计的内容与方法 本章小结 思考与练习第2章 货币市场与资本市场统计分析 第一节 货币市场与资本市场概述 第二节 资本市场与货币政策的相互影响 第三节 我国资本市场与货币政策的协整关系 本章小结 思考与练习第3章 有价证券的价值分析 第一节 影响股票价格的因素分析 第二节 股票价格的计量模型 第三节 债券的投资价值分析和债券收益率分析 第四节 投资基金的价值分析 第五节 其他投资基金的价值分析 第六节 市盈率分析 本章小结 思考与练习第4章 通货膨胀统计理论及其方法 第一节 通货膨胀概述 第二节 我国通货膨胀的成因及其实证分析 第三节 通货膨胀与经济增长之间的关系 第四节 我国通货膨胀形成原因的实证分析 第五节 对治理通货膨胀的几点建议 本章小结 思考与练习第5章 外债监测统计指标理论体系 第一节 外债统计的概念和作用 第二节 外债监测统计指标体系及其分析 本章小结 思考与练习第6章 证券市场价格指数理论体系 第一节 股票价格指数体系 第二节 债券价格指数 本章小结 思考与练习第7章 证券投资组合理论与方法 第一节 马柯维茨的证券组合理论 第二节 证券组合分析的简化模型 本章小结 思考与练习第8章 VaR模型及其实证分析 第一节 VaR方法产生的背景及历史沿革 第二节 VaR概述 第三节 VaR模型的计算方法 第四节 VaR模型的事后检验 第五节 VaR的实证分析 本章小结 思考与练习第9章 金融高频数据 第一节 金融高频数据分析的现状与问题 第二节 我国证券市场高频数据的分布特性 第三节 高频数据的自回归条件期间模型及其实证分析 本章小结 思考与练习第10章 金融风险预警指标体系及预警方法 第一节 金融风险的内涵及金融危机的成因 第二节 国内外金融风险预警指标体系评价 第三节 金融风险预警方法评价 第四节 建立我国的金融预警系统 第五节 我国金融风险预警指标体系的确立 第六节 建立五灯显示预警系统 本章小结 思考与练习思考与练习参考答案主要参考文献

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>