

<<全球股票指数编制及其汇率难题解析>>

图书基本信息

书名：<<全球股票指数编制及其汇率难题解析>>

13位ISBN编号：9787309091250

10位ISBN编号：7309091256

出版时间：2012-9

出版时间：复旦大学出版社

作者：张宏鸣

页数：120

字数：109000

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>

## <<全球股票指数编制及其汇率难题解析>>

### 内容概要

张宏鸣所著的《全球股票指数编制及其汇率难题解析——全球股票50指数设计及应用方案》提出了四种编制全球股票指数的基本思路，并利用样本股指为变量、进出口额为权重编制全球股指的构想，从变量、权重、算法上实现了全球股票指数的创新设计，基本消除了汇率波动干扰。

对股指期货、期权交易按合约——币种选配的新创意设计多币种合约产品，使避免汇率风险成为可能。

此外，本书还分析比较了各国股票市值、GDP、进口额、出口额、进出口额作权重的优劣，认为进出口额与全球经济的关联性最好，且汇率折算的影响也最小。

《全球股票指数编制及其汇率难题解析——全球股票50指数设计及应用方案》适合高等院校金融学、经济学等专业师生作为教学参考书使用，也可作为金融管理、股票证券管理人员的参考读物。

#### 作者简介

张宏鸣，经济学博士后，复旦大学基金会主任，复达投资管理有限公司高层管理人员。研究方向为金融投资、资产管理等、著有《上海国际金融中心形成路径研究》等著作，发表专业论文多篇。

书籍目录

第一章 绪论

- 第一节 研究背景
- 第二节 全球股票指数的定义
- 第三节 全球股票指数的现状
- 第四节 全球股票指数研究和应用存在的问题
- 第五节 研究的框架、方法及创新

第二章 全球股票指数的经济功能

- 第一节 全球经济的“晴雨表”
- 第二节 全球资源配置功能
- 第三节 投资、投机、资产管理的工具
- 第四节 避险功能
- 第五节 取代美国股指世界股市的主导地位

第三章 全球股票指数设计的基本思路

- 第一节 全球公司股票指数
- 第二节 全球交易所股票指数
- 第三节 全球国家股票指数
- 第四节 全球洲(地区)股票指数
- 第五节 全球股票指数分类

第四章 全球股票指数设计的方法

- 第一节 全球股票指数编制的样本选择
- 第二节 全球股票指数编制的权重选择
- 第三节 全球股票指数编制算法选择
- 第四节 全球股票指数编制算法评点
- 第五节 全球股票指数股价及结构调整因子

第五章 消除汇率对全球股票指数扰动的方法

- 第一节 汇率折算与目标货币问题
- 第二节 汇率对股票指数的扰动程度
- 第三节 消除汇率通过样本价格扰动非加权指数的方法
- 第四节 消除汇率通过样本价格扰动加权指数的方法
- 第五节 减小汇率通过权重扰动指数的方法

第六章 全球股票指数权重比较分析

- 第一节 市值、GDP权重分析
- 第二节 最大权重样本在指数中权重上限探讨
- 第三节 进口额、出口额权重分析
- 第四节 进出口额、商品和服务贸易进出口额权重分析
- 第五节 进出口额权重的优势

第七章 全球股票50指数设计方法和方案

- 第一节 全球股票50指数设计的目标和基本方法
- 第二节 全球股票50指数编制的权重和样本变量选择
- 第三节 全球股票50指数结构和设计目标考察
- 第四节 全球股票50指数的计算
- 第五节 每年调整样本国家(股指)及权重时的GSI调整

第八章 全球股指衍生交易方案设计及应用问题

- 第一节 股票指数衍生交易的发展趋势
- 第二节 全球股票指数衍生交易的优点

第三节 全球股票指数期货交易设计方案

第四节 全球股票指数期权交易设计方案

第五节 全球股票指数应用问题

参考文献

编辑推荐

《全球股票指数编制及其汇率难题解析：全球股票50指数设计及应用方案》提出了四种编制全球股票指数的基本思路，利用样本股指编制全球股指的构想，实现了股指编制方法上的创新。通过详细的推导和验证，将指数公式中的股价变量变换为股价涨跌幅，彻底消除了汇率波动通过股价汇率折算对全球股票指数的影响，对尚未解决的汇率波动扰动全球股指的世界性关键难题找到了一种根本解决办法。

分析比较了各国股票市值、GDP、进口额、出口额、进出口额作权重的优劣，发现进出口额与全球经济的关联性最好，且汇率折算的影响也最小，推荐进出口额为优选权重。

对股指期货、期权交易按合约——币种选配的新创意设计多币种合约产品，使股指可以以本币或世界主要币种交易，回避了汇率折算，使避免汇率风险成为可能。

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>