

数学

股指期货的风险度量方法研究

何树红, 武剑, 陶粉娥

收稿日期 修回日期 网络版发布日期 接受日期

摘要

股指期货是以某种股票指数为标的资产的期货合约.由于股票指数本身的波动性很大,因此对股指期货风险的度量就有较大的难度.通过对VaR模型、ES模型、POT模型的研究比较,找到其中比较适合我国股指期货的风险度量模型.

关键词 [股指期货](#) [VaR模型](#) [ES模型](#) [POT模型](#)

分类号

DOI:

通讯作者:

作者个人主页: 何树红; 武剑; 陶粉娥

### 扩展功能

本文信息

▶ [Supporting info](#)

▶ [PDF](#)(384KB)

▶ [\[HTML全文\]](#)(0KB)

▶ [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](#)

相关信息

▶ [本刊中 包含“股指期货”的 相关文章](#)

▶ 本文作者相关文章

· [何树红](#)

· [武剑](#)

· [陶粉娥](#)