

Салин В.Н., Добашина И.В.

Биржевая статистика: Учеб. пособие. - М.: Финансы и статистика, 2003.- 176 с.: ил.

ISBN 5-279-02753-7

Рассмотрены статистика ценных бумаг (формирование курсов, оценка, расчеты доходности, анализ риска и инвестиционного качества); статистика брокерско - дилерских компаний и других профессиональных участников рынка ценных бумаг. Детально раскрыта статистика фондовых и срочных бирж: конъюнктура, структура и оборот рынков; бирж как субъектов хозяйственной деятельности. Приведены основы анализа и источники биржевой информации. Изложена методология фондовых индексов (опыт международной и российской практики) и принципы их конструирования.

Для преподавателей, аспирантов, студентов экономических вузов, менеджеров, экономистов.

Оглавление

| | |
|--|-----------|
| Предисловие | 5 |
| Глава 1. СТАТИСТИКА ЦЕННЫХ БУМАГ | 9 |
| 1.1. Предмет и задачи статистики ценных бумаг..... | 9 |
| 1.1.1. Ценные бумаги как объект статистического изучения (9). | |
| 1.1.2. Предмет статистики ценных бумаг (11). | |
| 1.1.3. Задачи статистики ценных бумаг (12). | |
| 1.2. Информационное обеспечение статистики ценных бумаг | 12 |
| 1.3. Система показателей статистики ценных бумаг | 17 |
| 1.3.1. Статистика курсов ценных бумаг (17). | |
| 1.3.2. Статистика объемов и структуры операций с ценными бумагами (24). | |
| 1.3.3. Статистика деятельности участников рынка ценных бумаг (28). | |
| 1.3.4. Статистика качества ценных бумаг (34). | |
| 1.4. Оценка ценных бумаг и расчет их доходности..... | 39 |
| 1.4.1. Оценка различных типов облигаций и расчет некоторых видов доходности облигаций (39). | |
| 1.4.2. Оценка обыкновенных акций и расчет показателя доходности акций (53). | |
| 1.4.3. Соотношение риска и доходности инвестиций в ценные бумаги (55). | |
| 1.4.4. Методы статистического анализа, используемые при оценке рискованности инвестиций (61). | |
| Глава 2. СТАТИСТИКА БИРЖ (НА ПРИМЕРЕ ФОНДОВОЙ И СРОЧНОЙ БИРЖ) | 67 |
| 2.1. Предмет и задачи биржевой статистики | 67 |
| 2.1.1. Фондовая и срочная биржи (67). | |
| 2.1.2. Задачи статистики фондовой и срочной бирж (69). | |
| 2.2. Информационное обеспечение | 70 |
| 2.2.1. Особенности формирования первичной финансовой биржевой информации (70). | |
| 2.2.2 Структура информационного обеспечения (72) | |
| 2.3. Система показателей статистики фондовых и срочных бирж | 73 |
| 2.3.1. Показатели объема биржевых торгов (74). | |
| 2.3.2. Статистические таблицы, используемые в анализе результатов биржевых торгов (77). | |
| 2.3.3. Показатели качества фондового биржевого рынка (79). | |
| 2.4. Статистические показатели фондовых бирж как организаций, ведущих хозяйственную деятельность | 86 |

| | |
|---|------------|
| 2.5. Чтение международных биржевых статистических данных (акции и облигации) | 88 |
| 2.6. Статистика производных финансовых инструментов..... | 90 |
| 2.7. Статистические методы, используемые при анализе показателей биржевой статистики..... | 92 |
| Глава 3. ФОНДОВЫЕ ИНДЕКСЫ | 102 |
| 3.1. Цели создания фондовых индексов..... | 102 |
| 3.2. Классификация фондовых индексов | 102 |
| 3.3. Методология расчета индексов акций | 103 |
| 3.3.1. Методы расчета индексов цен (103). | |
| 3.3.2. Методы расчета индексов акций (108). | |
| 3.3.3. Фондовые индексы с учетом взвешивания (112). | |
| 3.4. Индексы акций развитых фондовых рынков | 117 |
| 3.5. Индексы акций формирующихся рынков..... | 122 |
| 3.6. Особенности расчета российских индексов акций | 124 |
| 3.7. Международные индексы..... | 130 |
| 3.8. Методология расчета индексов облигаций | 134 |
| 3.9. Волатильность. | 135 |
| Заключение..... | 145 |
| Приложения..... | 147 |
| 1. Основные биржевые индексы | 147 |
| 2. Перечень изданий, публикующих информацию по фондовому рынку | 163 |
| 3. Интернет - сайты, содержащие статистику, включая информацию о фондовых индексах | 164 |
| Литература..... | 169 |
| Краткий словарь терминов..... | 170 |