

图书基本信息

书名：<<股票指数现货市场与期货市场关系研究>>

13位ISBN编号：9787504940261

10位ISBN编号：7504940267

出版时间：2006-9

出版时间：中国金融出版社

作者：肖辉

页数：334

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

本书内容分为三篇，第一篇分析了全球股票市场和股票指数期货市场的发展状况，主要介绍了20世纪90年代和21世纪的股票市场发展状况，目前中国在全球股票市场中的地位。

第二篇从股票指数现货市场与股指期货市场的实际情况出发，比较了存在交易成本和现货市场卖空限制条件下的现货市场和期货市场之间的微观结构，丰富和发展了金融市场微观结构理论。

提出了基于期货合约的现货定价模型，并且通过股指期货市场预测能力的比较进一步验证了期货价格信息在预测现货价格中起重要作用的结论。

第三篇研究了如何控制股票指数期货市场风险问题，比较了股票指数期货与标的指数波动率之间的关系，深入研究了股指期货的保证金制度、涨跌停板以及市场熔断机制。

书籍目录

第一篇 全球股票市场与股指期货市场发展概论 第一章 全球股票市场发展概述 1.1 20世纪90年代的股票市场 1.2 21世纪的股票市场 1.3 中国内地股市在全球股市的地位 第二章 全球股指期货市场发展概述 2.1 交易量迅猛增长 2.2 北美重新取得龙头老大地位 2.3 新产品后来居上 2.4 亚洲新兴市场发展迅速 第三章 股指期货市场与现货市场相对分离的演化分析 3.1 期货市场发展路径的变化 3.2 期货市场的多样性选择 3.3 大多数股指期货合约在期交所上市 3.4 交易所欣起整合浪潮 3.5 中国内地应该推出股指期货 第二篇 股票指数现货市场与期货市场有效性比较及定价研究 第四章 现货市场与衍生品市场关系研究及定价理论回顾 4.1 引言 4.2 股票指数现货市场与期货市场关系研究 4.3 定价理论回顾 4.4 主要研究结论和章节结构 第五章 现货市场与期货市场交易者策略和价格有效性比较 5.1 引言 5.2 市场微观结构理论 5.3 模型假设与符号说明 5.4 交易者策略分析 5.5 现货市场与期货市场价格有效性比较 5.6 本章总结 第六章 现货市场与期货市场信息传播实证研究 6.1 引言 6.2 现货市场与期货市场效率关系 6.3 研究方法 6.4 日间数据检验 6.5 日内数据检验 6.6 本章总结 第七章 现货市场与期货市场价格发展实证研究 7.1 引言 7.2 价格发现 7.3 研究方法 7.4 日间数据检验 7.5 日内数据检验 7.6 本章总结 第八章 现货市场与期货市场流动性比较 8.1 引言 8.2 市场流动性 第九章 基于期货合约的定价模型 第十章 现货市场与期货市场价格预测能力比较 第三篇 股指期货与现货市场的价格 第十一章 股指期货与标的指数波动率比较研究 第十二章 股指期货合约基准保证金设备研究 第十三章 股指期货合约停板与熔断机制研究 附录参考文献后记

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>