

<<股票指数期货交易策略及风险管理研>>

图书基本信息

书名：<<股票指数期货交易策略及风险管理研究>>

13位ISBN编号：9787564009427

10位ISBN编号：756400942X

出版时间：2007-4

出版时间：北京理工大学出版社

作者：王宝森 编

页数：196

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

本书对股票指数期货交易及风险管理进行了系统研究。

共分为七章，分别研究了股票指数期货的基本理论、标的指数的要求与期货合约的设计原则；股票指数期货的套利、套期保值、投机交易策略；股票指数期货的风险管理方法和体系。

本书立足于理论前沿和股票指数期货的实践，在股票指数期货的交易和风险管理上多处创新，知识性与操作性兼备，注重案例，可读性好。

本书可用作经济、金融等专业高年级本科生和研究生相关课程的教材和教学参考书，也可供金融业从业人员或有兴趣的读者阅读参考。

书籍目录

第一章 导论 1.1 股票指数 1.2 股票指数期货 1.3 文献综述第二章 股票指数期货的必要性及其合约设计 2.1 股指期货的必要性 2.2 股指期货交易的可行性 2.3 股指期货合约设计第三章 股票指数期货定价与套利交易策略 3.1 股指期货套利交易概述 3.2 无套利理论定价 3.3 股票现货与股指期货之间的套利 3.4 股票现货与股指期货之间的套利策略的变形 3.5 其他类型套利交易策略 3.6 我国的股指期货套利策略及风险分析第四章 股票指数期货套期保值交易策略 4.1 股指期货套期保值的特征和类型 4.2 套期保值的交易原则及策略 4.3 套期保值对期货市场的作用 4.4 基差理论 4.5 股指期货不确定性最小风险保值比率的综合处理 4.6 套期保值原理模型第五章 股票指数期货的投机交易策略及神经网络的应用 5.1 股指期货的投机交易概述 5.2 人工神经网络 5.3 BP人工神经网络在投机交易预测分析中的应用 5.4 BP人工神经网络在S&P500股指期货投机中的实例分析 5.5 我国的股指期货投机交易第六章 股票指数期货交易风险及VaR应用 6.1 股票指数期货的交易风险 6.2 度量股指期货交易风险的VaR方法 6.3 估算VaR值的异方差模型 6.4 S&P500股指期货市场风险的VaR实证分析 6.5 我国运用VaR技术的问题和建议第七章 股票指数期货风险管理机制研究 7.1 国外股指期货市场监管模式 7.2 我国股指期货市场监管模式探讨 7.3 我国股指期货交易的风险监管措施结束语参考文献

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>