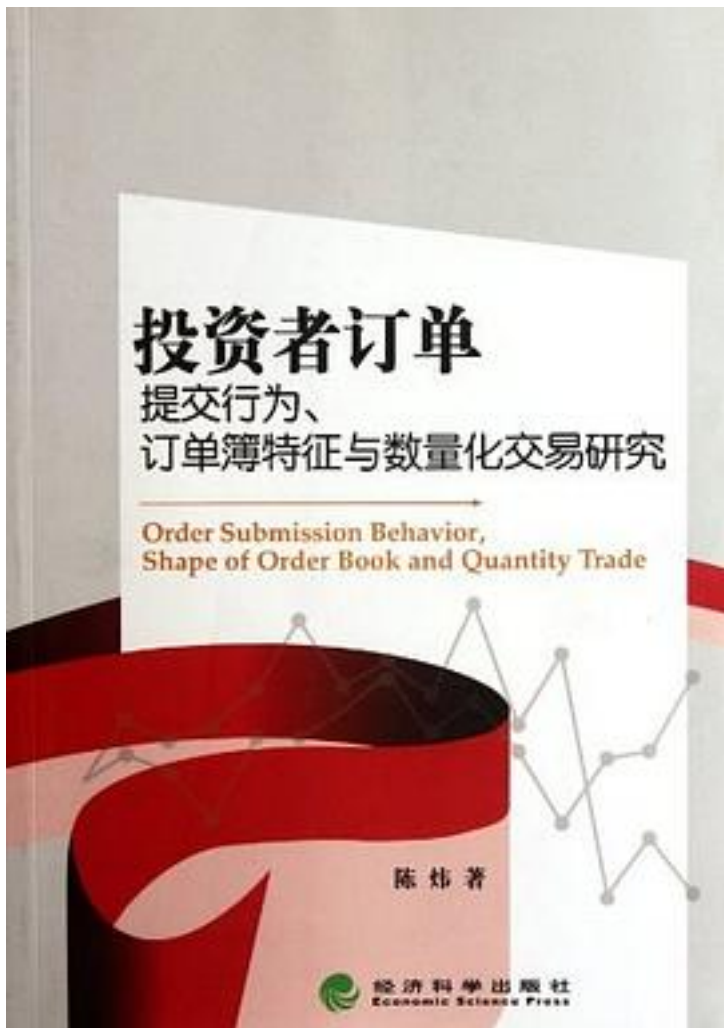


投资者订单提交行为订单簿特征与数量化交易研究



[投资者订单提交行为订单簿特征与数量化交易研究_下载链接1](#)

著者:陈伟

出版者:

出版时间:2012-5

装帧:

isbn:9787514115246

《投资者订单提交行为、订单簿特征与数量化交易研究》由陈伟编著。

证券市场的交易机制主要可以分为报价驱动市场（Quote-driven Market）和订单驱动市场（Order-driven Market）两类。报价驱动市场依靠做市商提供流动性，订单驱动市场则依靠限价订单提供流动性。投资者掌握市场信息的质与量、订单簿透明度以及投资者的交易需求目标都会影响投资者订单提交策略和行为，进而影响市场上订单簿构成与变化，最终影响价格发现过程和市场质量。《投资者订单提交行为、订单簿特征与数量化交易研究》旨在从理论与实证两个角度研究中国股市限价订单簿特征、分布和订单提交策略及行为，并在此基础上分析订单簿透明度的影响、订单执行成本（交易成本）等与订单相关的重要问题，最后介绍了数量化交易的理论与实践等内容。

作者介绍:

目录: 第一章 导言

第二章 文献综述

第一节 投资者订单提交策略和行为的理论

第二节 投资者订单提交策略和行为的实证研究

第三节 投资者订单选择的实证研究

第四节 限价订单簿特征与形状

第五节 限价和市价订单的绩效及对市场的影响

第三章 订单类型、订单传输与撮合

第一节 主要订单种类

第二节 订单撮合与价格形成

第三节 中国股市订单报盘系统

第四节 中国股市订单特征与概况

第五节 美国股票市场订单处理

第六节 黑池发展与订单处理

第四章 中国股票市场订单簿特征的理论与实证

第一节 中国股票市场订单簿特征与形状的实证分析

第二节 中国股票市场限价订单模型的实证分析

第五章 投资者订单提交策略的实证研究

第一节 文献回顾

第二节 研究假说

第三节 描述性统计

第四节 实证结果与分析

第五节 结论与启示

第六章 投资者订单提交持续期研究

第一节 文献回顾

第二节 研究设计

第三节 实证结果与分析

第四节 其他假说的检验

第五节 结论与启示

第六节 政策建议

第七章 交易信息透明度的理论和实证分析

第一节 信息透明度的定义

第二节 交易信息公开的时效性

第三节 世界各国和地区市场订单簿的信息透明度

第四节 信息透明度的影响分析

第五节 总结分析

第八章 订单簿信息透明度提高的影响

第一节 研究设计

第二节 实证结果

第三节 总结分析

第九章 中国股票市场交易成本

第一节 股票的交易成本度量

第二节 交易成本的国际趋势

第三节 中国股市交易成本与国际比较

第四节 交易成本影响因素的实证研究

第十章 数量化交易

第一节 数量化交易概念与现状

第二节 算法交易

第三节 高频交易

第四节 套利与风险对冲

第五节 数量化交易的主要参与者

第六节 数量化交易对市场的影响

第七节 国内数量化交易的情况

参考文献

•

•

•

•

•

•

(收起)

[投资者订单提交行为订单簿特征与数量化交易研究_下载链接1](#)

标签

交易

量化

投资

Microstructure

量化投资

金融工程

评论

本科论文就是靠它混过来的

[投资者订单提交行为订单簿特征与数量化交易研究_下载链接1](#)

书评

[投资者订单提交行为订单簿特征与数量化交易研究_下载链接1](#)