

中国期货市场基本功能和信息溢出研究



[中国期货市场基本功能和信息溢出研究 下载链接1](#)

著者:

出版者:

出版时间:2008-5

装帧:

isbn:9787811133080

《中国期货市场基本功能和信息溢出研究》的研究分以下几部分展开。第一部分：第1章，为引论部分。简要地介绍期货的基本知识以及与期货紧密相关的金融衍生品知识，包括期货市场结构及其两项基本功能—规避风险和价格发现，同时对我国期货市场的发展现状进行了介绍。第二部分：第2章至6章，为期货规避风险。即套期保值的研究。包括了套期保值策略中最优套期保值比率的建模确定，以及部分套期保值问题的深入研究。第三部分：第7章，为期货市场价格发现功能的研究。介绍了两个基于共有因子分解的价格发现模型：Gonzalo与Granger (1995) 提出的PT (永恒短暂) 模型以及Hasbrouck (1995) 提出的IS (信息共享) 模型，并利用PT模型研究了国内铜、铝、燃料油、橡胶和玉米期货与现货的价格发现功能。第四部分：第8章至10章，为国内期货市场泡

沫、投机理论分析以及相关的市场结构分析。主要包括了国内期货市场泡沫理论分析、投资者行为研究和国内外市场结构比较分析。第五部分：第11章，为国内外期货市场间信息溢出的研究。通过一个新的基于核估计的统计量，系统地研究了9种交易时间较长的期货品种间的国内外信息溢出问题。最后是总结，概述了《中国期货市场基本功能和信息溢出研究》的主要研究结论，并提出了一些有关发展与完善国内期货市场的政策建议。《中国期货市场基本功能和信息溢出研究》对于系统地了解我国期货市场的现状和市场规律有重要参考价值。

作者介绍：

目录：

[中国期货市场基本功能和信息溢出研究 下载链接1](#)

标签

专业书

评论

专业性很强的一本书，不怕死的就来看吧

[中国期货市场基本功能和信息溢出研究 下载链接1](#)

书评

[中国期货市场基本功能和信息溢出研究 下载链接1](#)