

# 中国期货市场微观结构研究



[中国期货市场微观结构研究 下载链接1](#)

著者:

出版者:

出版时间:2010-1

装帧:

isbn:9787030239457

《中国期货市场微观结构研究》以分析我国期货市场的日内效应为起点，以时间效应为

主线，利用计量经济学的最新研究成果，对我国期货市场微观结构进行了较为系统的研究。内容主要包括：中国期货市场简介、市场微观结构理论、中国期货市场收益率和交易量的日内效应、中国期货市场价格久期、交易量久期与持仓量久期、中国期货市场日内流动性分析、中国期货市场波动性分析、期货市场风险估计和中国期货与现货市场间信息溢出效应的研究。

《中国期货市场微观结构研究》适用于高等学校经济学、金融学、管理学、统计学等相关专业的师生以及相关研究领域的从事定量分析的研究人员。书中提出的一些政策建议对期货交易者和监督机构进行决策有一定的借鉴意义。

作者介绍:

目录:

[中国期货市场微观结构研究 下载链接1](#)

## 标签

期货

微观

金融学

经济学

投资——宏观

市场微观结构

价格投机

交易

## 评论

L型的日内波动性；流动性是开盘时最好；期货价格引导现货；  
另外，这本书大部分是用1分钟数据来分析的，作为微观研究，这个尺度可能大了点。

---

[中国期货市场微观结构研究 下载链接1](#)

## 书评

---

[中国期货市场微观结构研究 下载链接1](#)