

<<外汇市场微观结构理论与实证>>

图书基本信息

书名：<<外汇市场微观结构理论与实证>>

13位ISBN编号：9787504940575

10位ISBN编号：7504940577

出版时间：2006-8

出版时间：中国金融出版社

作者：丁剑平

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>

<<外汇市场微观结构理论与实证>>

内容概要

本书在占用大量文献资料的基础上，对当今最前沿的外汇市场微观结构理论及定价模型进行了系统梳理、总结和归纳，并利用该理论对中国外汇市场的汇率波动、中央银行干预的有效性及市场有效性进行了实证分析。

本书内容及所采用的分析方法具有一定的前沿性，对读者不无启发意义。

<<外汇市场微观结构理论与实证>>

作者简介

丁剑平，1957年8月31日生。
先后获对外经济贸易大学经济学学士、华东师范大学经济学硕士、日本一桥大学经济学硕士及博士学位。
现为上海财经大学教授、博士生导师，现代金融中心主任。
社会兼职有：中国金融学会理事、上海国际金融中心执行理事、上海世界经济学会理事、上海金融学会理事。
曾获日本兼松贸易团体的优秀论文奖、商务部全国外经贸研究成果奖、第十届安子介国际贸易研究优秀论文奖、全球金融学会第九届年会优秀论文奖等。
先后主持承担了国家自然科学基金项目、教育部人文社会科学研究课题项目、上海市哲学社会科学规划课题等。
出版专著《中国经济国际一体化进程的实证研究》、《人民币汇率与制度问题的实证研究》等，
在Journals Indexed in EconLit索引外刊上发表学术论文多篇。

<<外汇市场微观结构理论与实证>>

书籍目录

1 金融市场微观结构理论简介	1.1 金融市场微观结构理论的渊源	1.2 金融市场微观结构理论的发展综述
2 外汇市场的微观研究方法	2.1 外汇市场微观结构研究方法的发展背景	2.2 外汇市场微观结构理论的发展综述
2.3 外汇市场微观结构的基础理论	2.4 本章总结	3 外汇市场微观结构
3.1 外汇市场制度设计	3.2 外汇市场结构分析	3.3 外汇市场微观结构理论架构
3.4 我国外汇市场的结构	4 外汇市场微观结构理论的定价模型	4.1 存货模型
4.2 理性预期模型	4.3 批量交易模型	4.4 序贯交易模型
4.5 同时交易模型	4.6 中央银行干预的向观结构模型	4.7 微观结构理论与宏观汇率决定理论的比较
5 微观结构理论的实证研究	5.1 外汇市场的数据	5.2 统计模型和结构模型
5.3 经典实证研究回顾	6 外汇市场的有效性：理论与实证的偏差	6.1 引言——有效市场假说
6.2 随机游走分析	6.3 外汇市场有效性的实证检验	6.4 外汇市场有效性检验面临的实际问题
6.5 外汇市场有效性检验计量建模研究方法的最新发展及其趋势	6.6 本章小结	7 中国与各国外汇市场的实证研究
7.1 2000-2005年主要区域货币汇市波动特征的研究？	7.2 利率平价论适用于人民币的远期定价吗——新台币、韩圆与人民币远期市场的比较	7.3 中央银行外汇干预策略效果分析
7.4 中央银行的汇市干预效应参考文献		

<<外汇市场微观结构理论与实证>>

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>