

图书基本信息

书名：<<股指期货交易策略与市场质量研究>>

13位ISBN编号：9787504961808

10位ISBN编号：7504961809

出版时间：2011-12

出版时间：中国金融出版社

作者：中国金融期货交易所 编

页数：366

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

中国金融期货交易所主办了“第二届金融期货与期权研究征文大赛”，涌现出了一批理论功底扎实、贴近市场实际、具有指导意义的优秀研究成果。

本书选取部分获奖作品，共计16篇，内容主要集中在基础理论研究、策略应用及产品开发、套保套利研究等几方面。

文章内容密切结合股指期货市场最新发展情况，反映了股指期货上市后各方对于金融期货市场的思考及研究，具有一定实践价值和参考意义。

书籍目录

第一类 基础理论研究

- 沪深300股指期货市场质量研究
- 股指期货对股票市场影响研究
- 中国大陆、香港和台湾股指期货市场之间的信息传递效应研究
- 中国期货市场超高频时间序列ACD-GARCH-V-OI模型研究与数据分析

第二类 策略应用与产品开发

- 中小盘股指期货标的选择与合约设计研究
- 基于股指期货的开放式基金流动性风险管理
- 阿尔法策略国内应用的理论与实证研究
- 机构参与股指期货的资金管理
- 保护性卖权的股指期货复制策略

第三类 套保套剥专题研究

- 股指期货套期保值方案研究与应用
- 分形理论下的股指期货套期保值策略研究
- 考虑尾相关的套保比确定模型研究
- 股指期货展期套期保值策略
- 可降低基金套保风险的非对称套保策略
- 中国金融期货市场的特性和套期保值功能的提高
- 股指期货期现套利策略研究

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>