

<<期货价差套利>>

图书基本信息

书名：<<期货价差套利>>

13位ISBN编号：9787505858176

10位ISBN编号：7505858173

出版时间：2006-9

出版时间：经济科学出版社

作者：唐衍伟

页数：263

字数：300000

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>

## <<期货价差套利>>

### 内容概要

期货市场的价差套利行为促使市场价格趋于正常、增加市场流动性并降低市场风险，足期货订丁场功能得到有效发挥的重要保障。

期货市场价差套利是期货市场最主要的投资方式和风险管理手段之一，它是一个综合的、全面的和连续的投资决策过程，其间不仅包括对市场的内在机理和微观结构的认识 and 把握、价差套利机会的发现、投资组合与决策的优化，还包括预测与风险管理，一个完整的价差套利交易过程必须包括以上各环节，形成最终的价差套利执行策略，并在实行过程中不断根据新的情况加以调整和修正。

本书围绕期货价差套利，理论与应用相结合，吸取国内外金融、期货理论研究的最新成果，全面系统地研究了期货价差套利投资决策中的相关基本理论与方法，内容涌盖期货市场发展的现状、期货交易、期货市场特征分析、期货定价原理、价差套利定价原理、最优期货价差套利头寸比例、价差套利预测、价差套利风险管理与价差套利交易策略，并附有实证研究结果。

## <<期货价差套利>>

### 作者简介

唐衍伟，1970年生，山东青岛人；经济学硕士、管理学博士。

现为青岛大学经济学院副教授、硕士生导师；同济大学金融衍生品研究所研究员。

致力于资本市场与投融资管理、衍生品市场和产业经济等领域的研究；具有多家期货公司、投资公司的实习或从业经历。

在主要研究领域发表了二十多篇学术论文；主持和主要参与了十多项国家和省部级研究项目，并与政府机构和金融企业合作完成了多项证券、期货领域的重要应用研究课题。

## <<期货价差套利>>

### 书籍目录

第1章 引论 1.1 研究背景 1.2 研究意义 1.3 国内外研究现状 1.4 研究基本思路及主要研究内容  
第2章 期货市场概述 2.1 期货的定义 2.2 期货市场的产生与发展 2.3 我国期货市场的发展情况 2.4 期货、现货与远期的关系 2.5 期货市场的功能和作用 2.6 期货市场的组织结构 2.7 期货品种与合约 2.8 期货交易制度与交易流程 2.9 我国商品期货市场的概况  
第3章 期货交易 3.1 套期保值 3.2 期货投机 3.3 价差套利交易  
第4章 期货市场价格特征分析 4.1 期货市场有效性 4.2 期货价格的波动聚集性 4.3 期货价格的长程相关性 4.4 期货市场量价关系 4.5 周日效应与月度效应 4.6 期货市场价格发现功能 4.7 国内外期货市场相关性  
第5章 期货定价原理  
第7章 最优期货价差套利头寸比例  
第8章 期货价格预测  
第9章 期货价差套利风险管理  
第10章 期货价差套利交易策略  
第11章 期货价差套利实证研究参考文献

<<期货价差套利>>

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>