

《中国期货市场的波动性与风险控制》

图书基本信息

书名：《中国期货市场的波动性与风险控制研究》

13位ISBN编号：9787564200510

10位ISBN编号：7564200510

出版时间：2007-10

出版社：上海财经大学出版社

作者：刘庆富

页数：361

版权说明：本站所提供下载的PDF图书仅提供预览和简介以及在线试读，请支持正版图书。

更多资源请访问：www.tushu111.com

《中国期货市场的波动性与风险控制》

内容概要

我国期货市场仍然是新兴市场，相对于成熟的期货市场而言仍有诸多差距，在我国金融全面开放和金融衍生工具陆续推出的情况下，探索和总结我国期货市场的波动性特征、市场之间的关联性以及风险控制的经验和方法，对加强和改善我国期货市场的发展现状，推动我国期货市场的正常运营，特别是金融衍生品市场的发展，无疑具有很大的借鉴价值和现实意义。

《中国期货市场的波动性与风险控制》

作者简介

刘庆富，男，1973年9月生，山东人，东南大学管理科学与工程专业博士，复旦大学应用经济学博士后，现供职于复旦大学金融研究院。主要研究兴趣为期货市场、金融风险管理与金融工程。近年来，在《金融研究》、《世界经济》、《系统工程学报》和《管理工程学报》等国内外重要期刊发表论文近三十篇，主持和参加以期货市场为研究内容的国家自然科学基金等省部级课题五项。

《中国期货市场的波动性与风险控制》

书籍目录

前言1 中国期货市场价格波动的基本统计特征 1.1 引言 1.2 期货价格收益的基本统计量及正态性检验
1.3 期货价格收益的自相关检验 1.4 期货价格收益的条件异方差检验 1.5 期货价格及期货价格收益的平稳性检验
1.6 期货价格收益的随机游走检验 1.7 期货价格收益及波动方差的周日历效应研究 1.8 期货价格收益及波动方差的长记忆性研究 1.9 小结2 中国期货市场的量价波动性关系 2.1 引言 2.2 期货交易量、空盘量、价格收益和总体波动的统计分析 2.3 期货价格收益与交易量和空盘量之间的关系 2.4 期货市场总体波动与正负收益、交易量和空盘量之间的关系 2.5 小结3 中国期货市场与现货市场之间的波动性关系 3.1 引言 3.2 期货市场与现货市场之间的协整关系 3.3 期货市场与现货市场之间的引导关系 3.4 期货市场与现货市场之间的波动溢出效应 3.5 小结4 国内与国际期货市场之间的波动性关系 4.1 引言 4.2 国内与国际期货市场之间的关联性 4.3 国内与国际期货市场之间的波动溢出效应 4.4 国内与国际期货市场之间的定价功能 4.5 小结5 中国期货市场的价格波动行为特征与风险成因 5.1 引言 5.2 期货市场期货价格波动的统计特征 5.3 现货价格与期货价格的波动性特征 5.4 期货市场的风险成因 5.5 小结6 中国期货市场的风险测度 6.1 引言 6.2 VaR简介 6.3 RVaR—GARCH模型族的构建 6.4 实证结果与分析 6.5 中国期货市场风险变动趋势及原因 6.6 小结7 中国期货市场价格操纵行为分析 7.1 引言 7.2 期货市场“价格操纵”的界定 7.3 期货市场价格操纵行为的主要表现形式8 期货市场价格操纵行为的动态识别方法9 中国期货市场价格操纵监控体系的构建及对策建议附录参考文献

《中国期货市场的波动性与风险控制》

精彩短评

- 1、对个人投资者确实没什么用处，做期货分析的研究员可以好好看看。
- 2、这类书只要有那么一点点你想要的，也就算值得了
- 3、收获不大，对个人投资者用处不大。

《中国期货市场的波动性与风险控制》

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：www.tushu111.com