

《中国期货价格行为特征与市场稳定弧

图书基本信息

书名：《中国期货价格行为特征与市场稳定机制研究》

13位ISBN编号：9787308057141

10位ISBN编号：7308057143

出版时间：2008-2

出版社：浙江大学出版社

作者：楼迎军

页数：277

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

《中国期货价格行为特征与市场稳定弧

内容概要

《中国期货价格行为特征与市场稳定机制研究》系统和深入地研究了我国期货价格行为及其复杂性，并在此基础上探讨完善我国期货市场稳定机制的基准和效果的可能途径。全文大致分为四个部分：第一部分基本上属于概述性质，主要为整体的研究奠定基础，有利于后继定量研究和分析的展开。第二部分主要是对期货价格行为的深入研究。包括对我国期货市场及其稳定机制的研究，对我国期货价格暴涨暴跌行为的研究，对我国期货价格的波动性特征研究以及对期货价格行为的非线性动力学研究。第三部分主要是针对期货市场稳定机制的研究，包括对期货保证金最佳设定水平的研究和对我国期货市场风险预警机制的初步研究。第四部分即结论与建议部分，是总结性章节。

《中国期货价格行为特征与市场稳定弧

作者简介

楼迎军，1973年12月出生，浙江义乌人，2005年毕业于浙江大学，获管理学博士学位，浙江工商大学金融学院副院长，副教授，现隶属于金融学院证券投资系和证券期货研究所。2000年开始主要从事金融市场和投资理论的教学与研究，并在《世界经济》、《科研管理》、《中国软科学》、《中国管理科学》、《浙江社会科学》、《价格理论与实践》等核心期刊上发表论文16篇，有一篇获2004年度浙江省金融学会优秀论文一等奖。并主持了一项国家自然科学基金课题、一项省教育厅课题，一项省社科联课题，并作为主要参与者参加了两项国家自然科学基金课题，两项国家期货业协会课题，一项上海期货交易所课题，一项省社会科学基金课题。

《中国期货价格行为特征与市场稳定弧

书籍目录

- 01 绪论 1.1 研究背景 1.2 研究动机与目的 1.3 研究方法与内容 1.4 研究创新与重要结论 1.5 研究限制与不足之处 1.6 研究路线
- 02 文献与研究综述 2.1 极值理论的文献综述 2.2 价格波动性的文献综述 2.3 价格长记忆效应研究综述 2.4 期货保证金制度文献综述 2.5 本章小结
- 03 我国期货市场及其稳定机制概述 3.1 我国期货市场的发展 3.2 我国期货市场稳定机制及影响因素分析 3.3 价格行为与市场稳定机制权衡：兼论风险事件启示 3.4 本章小结
- 04 基于EVT理论的我国期货价格暴涨暴跌行为研究 4.1 研究目的与动机 4.2 稳定的Paretian分布 4.3 极值理论概述 4.4 研究方法 4.5 实证结果及分析 4.6 本章小结
- 05 我国期货价格的波动性研究 5.1 价格波动性概述 5.2 ARCH-family模型概述 5.3 期货价格波动性的实证分析 5.4 本章小结
- 06 我国期货价格行为的非线性动力学研究 6.1 价格行为的非线性动力学特征概述 6.2 研究方法 6.3 实证分析 6.4 结论与建议
- 07 我国期货保证金的最佳设定水平研究 7.1 目的与动机 7.2 国内外期货市场保证金制度概况 7.3 研究方法 7.4 实证分析与结果 7.5 本章小结
- 08 我国期货市场风险预警机制的初步研究 8.1 目的与动机 8.2 期货风险预警指标体系的建立 8.3 风险预警指标体系的ISM-AHP结构分析 8.4 风险预警系统的初步设计... 8.5 期货市场风险预警的预控对策 8.6 本章小结
- 09 总结与展望 9.1 总结 9.2 研究展望附表 《期货市场风险预警机制设计》访谈调查表参考文献后记

03 我国期货市场及其稳定机制概述 现代的期货交易出现在1848年的芝加哥期货交易所（CBOT），我国期货市场起步于1990年成立的郑州粮食批发市场。1848年美国82个商人建立CBOT的初衷，就是看中了期货市场通过发现未来价格分散和转移谷物经营风险的功能和作用。这种作用随着期货市场规模的扩大、品种的丰富、影响的广泛，日益得到社会的认同。如今，不仅美国这样期货市场发达国家的政府充分肯定期货市场在国家经济发展中的重要作用，就连非洲的农户都知道利用期货市场来保护自己的利益。但是也应注意到，期货市场的经济功能和作用是通过比较特殊的具有双向交易和杠杆交易机制的期货交易实现的，“零和（zero-sum）”游戏规则期货交易具有很强的对抗性。从国内外期货市场运行的实践看，价格风险，无论是系统性的价格风险还是非系统性的价格风险，如果市场信息不完备、稳定机制的制度缺陷和组织无效，往往会引发投资者的机会主义行为，从而引发风险事件。因此，认识期货市场稳定机制及其与期货价格行为之间存在的权衡关系（trade-off），对于科学监管和完善市场稳定机制是重要的。本章分为三个部分：第一部分介绍的是我国期货市场的发展历程，从整体上把握我国期货市场的制度变迁，了解我国期货市场现状；第二部分则分为外生稳定机制和内生稳定机制，分别阐述影响我国期货市场稳定发展的因素；第三部分结合我国期货市场风险事件的分析，阐述价格行为和市场稳定机制之间的权衡关系。……

《中国期货价格行为特征与市场稳定弧

精彩短评

- 1、可借鉴之处很多.
- 2、分析的功力挺好，应该是博士论文出版的吧
- 3、这类书只要有那么一点点你想要的，也就算值得了，一般投机者就不用看了。

《中国期货价格行为特征与市场稳定弧

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