第一图书网, tushu007.com

<<中国农产品期货基差动态调整过>>

图书基本信息

书名：<<中国农产品期货基差动态调整过程及策略分析>>

13位ISBN编号：9787030294739

10位ISBN编号：7030294734

出版时间：2011-1

出版时间：科学出版社

作者：易蓉，汪寿阳　著

页数：216

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

第一图书网, tushu007.com

<<中国农产品期货基差动态调整过>>

内容概要

基差直接影响套期保值的效果，其变动还具有价格发现和信息传递等重要功能，因此，基差动态调整过程及策略分析具有十分重要的意义。

本书从我国农产品期、现货价格实际走势及相互关系进行实证分析，洞察我国大宗农产品期货基差序列的特性；结合动态系统理论、期货价格期限结构理论、期货价格预期理论和风险溢价理论，建立与我国农产品期货基差特性相符合的动态调整模型；归纳农产品价格风险管理中的基差策略，为有效管理价格风险提供有力工具。

本书适合于期货投资者、企业风险管理者、研究者及高校师生参考阅读。

第一图书网, tushu007.com

<<中国农产品期货基差动态调整过>>

书籍目录

总序前言绪论　第一节　基差研究意义及本书结构　第二节　基差概述及研究综述第一篇　农产品期货市场简介　第一章　期货市场概述　　第一节　期货市场的产生　　第二节　期货市场的功能　第二章　农产品期货市场发展状况　　第一节　国际农产品期货市场发展状况　　第二节　我国农产品期货市场发展状况第二篇　农产品期现关系理论及实证　第三章　农产品期现关系比较　第四章　期现价格关系理论综述　　第一节　期货市场效率性及文献综述　　第二节　期货市场效率性的检验理论　　第三节　期货价格发现功能检验理论　第五章　我国农产品期现关系实证　　第一节　农产品期现价格数量分析　　第二节　农产品期货价格发现功能检验　　第三节　小结第三篇　基差模型及基差策略　第六章　理论知识与研究方法　　第一节　随机过程　　第二节　状态空间模型　　第三节　卡尔曼滤波　　第四节　GARCH模型　　第五节　小结　第七章　预期理论框架的基差模型　　第一节　预期理论与商品期货价格期限结构模型　　第二节　农产品价格随机模型　　第三节　预期理论的期货价格公式　　第四节　基差模型　　第五节　小结　第八章　预期理论检验　　第一节　预期理论的质疑　　第二节　预期理论检验方法及实证　　第三节　小结　第九章　风险溢价条件的基差模型　　第一节　风险溢价理论　　第二节　风险溢价条件的期、现货价格关系　　第三节　STATE—SPACE—GARCH模型　　第四节　实证分析　　第五节　小结　第十章　农产品价格风险管理的基差策略　　第一节　农产品套期保值的风险　　第二节　套期保值的基差策略　　第三节　基差交易模式　　第四节　小结　第十一章　结论与建议　　第一节　结论　　第二节　启示及建议参考文献参考网站

第一图书网, tushu007.com

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