

<<股指期货应用策略与风险控制>>

图书基本信息

书名：<<股指期货应用策略与风险控制>>

13位ISBN编号：9787504950758

10位ISBN编号：7504950750

出版时间：2009-7

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：383

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>

## <<股指期货应用策略与风险控制>>

### 前言

2008年秋,美国次贷危机全面爆发,引发了全球性的经济和金融危机。与颇受指责的场外衍生品市场相比,全球股指期货、期权市场表现出色,交易量显著增加,市场运行安全平稳,避险功能充分发挥,成为金融海啸中的避风港。这样一场危机,引发了对现有金融发展模式的反思,各界针对金融发展、金融创新和金融监管展开了热烈讨论。

同时,这样一场危机也让我们有机会对股指期货等金融期货期权产品的功能、作用和风险有了更加全面和深刻的理解。

经过起起伏伏,市场对于尽快推出股指期货,完善股市内在稳定机制的呼声更加迫切。我们相信,股指期货的推出,不仅是积极应对当前金融危机、维护资本市场稳定的重要手段,更是符合市场基础运行规律、反映资本市场长期发展要求的改革方向,对于进一步夯实资本市场基础性制度建设,增强资本市场服务国民经济发展全局能力,有着十分重要的现实意义。

在中国证监会的领导下,中国金融期货交易所按照“高标准、稳起步”的原则,正在稳健扎实、有条不紊地推进股指期货筹备工作。

实现股指期货的平稳推出,需要市场各方的积极配合,客观认识股指期货等金融期货期权产品的功能和作用。

为了推动金融期货与期权研究的深化,为股指期货的上市创造良好的社会环境和研究氛围,中国金融期货交易所2008年组织了第一届“金融期货与期权研究征文大赛”。

在证券公司、期货公司、基金公司、商业银行、信息技术公司以及高校等研究单位的大力支持和热情参与下,本届征文圆满结束,最终评选出30篇获奖论文。

本书是本次征文获奖成果的选编,共19篇,内容主要集中在基础理论研究、产品设计与应用、市场监管与风险控制三方面。

由于论文来自金融期货和期权研究和业务一线人士,因此,论文选题具有前瞻性,内容密切结合当前市场实际,具有一定的理论和实践价值,反映了当前国内对金融期货、期权产品,尤其是正在筹备中的股指期货产品的思考、研究以及迫切需求。

希望本书的出版,能够起到促进交流、提高认识,深化金融期货和期权研究的作用。

## <<股指期货应用策略与风险控制>>

### 内容概要

本书收集了中国金融期货交易所“首届金融期货与期权研究征文大赛”中的获奖论文，这些论文不仅关涉前沿理论，还结合国际与国内期货、期权现状对实践中出现的问题进行了深入探讨，并提出相应的解决建议。

具体来说，本书收录的19篇论文分为理论基础类、产品设计与应用类、市场监管与风险控制类。作者包括了证券公司从业人员、高校研究人员等，他们从多方面对股指期货的理论及应用进行了深度分析，这些高质量的研究报告，不仅可以推动社会对金融期货市场的研究和认识，也为日后交易所各项研究合作的开展打下了良好基础。

## <<股指期货应用策略与风险控制>>

### 书籍目录

第一类 基础理论研究 事件对股指期货市场微观结构的影响研究 基于结构方程模型的股指期货投资者风险容忍度评估 国际主要股指期货及现货指数间当期因果联系探讨 沪深300指数与恒牛国企指数相关性分析 股指期货对现货走势的引导与预测：理论、实证与案例 沪深300指数调整的市场效应分析 衍生品交易员内幕交易行为动机研究及监管建议

第二类 产品设计与应用 公募基金130 / 30类多头空头投资组合：一类基于融资融券及股指期货的结构性产品 股指期货期现套利中的现货构建策略研究 Alpha策略与可转移Alpha策略 股指期货做市商制度研究及启示 CBOE波动率衍生品的发展及启示 基于非对称策略的绝对收益基金构建研究

第三类 市场监管与风险控制 VaR框架下SPAN风险控制系统的开发与应用研究 衍生品交易保证金模式的发展与研究 股指期货与现货联动操纵及反操纵研究 中国股指期货保证金设置的理论和实证分析 全球重大金融危机期间的股指期货异动 基于Copula—EVT模型的衍生品组合风险管理

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>