

<<交易制度交易策略与证券价格行为>>

图书基本信息

书名：<<交易制度交易策略与证券价格行为>>

13位ISBN编号：9787500486466

10位ISBN编号：7500486464

出版时间：2009-7

出版时间：中国社会科学出版社

作者：田存志

页数：296

字数：261000

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>

## <<交易制度交易策略与证券价格行为>>

### 内容概要

本书以交易制度、交易策略在证券价格决定中所扮演的重要角色为主线，以博弈论为分析工具，深入探讨了非对称信息的证券市场中的价格行为，尤其是系统地研究了隐性交易成本的日内变动模式。

本书的研究采取理论分析和经验分析相结合的分析方法，以理论分析为主、经验分析为辅。本书的研究不仅在市场微观结构相关研究领域具有一定的学术创新性，而且揭示了我国证券市场的微观结构特征，为证券市场的政策制定者以及监管者提供了旨在提高市场效率，降低交易成本的政策干预的理论依据。

## 作者简介

田存志，男，1969年生，教授、博士生导师。  
经济学博士、金融学博士后、数学博士后。  
主要讲授《高级微观经济学》等课程；已在《经济研究》等国内经济学核心期刊上发表了四十多篇学术论文；主持国家社科基金《机构投资者对中国股市的波动与作用机制研究》等课题研究；专著《金融工程与衍生产品创新研究：一种基于鞅定价的分析方法》曾获云南省政府第十一届社科研究成果一等奖。

书籍目录

第一章 导论

第一节 问题的提出

第二节 理论溯源

第三节 研究内容

第四节 研究方法

第二章 概念、方法及相关理论综述

第一节 引言

第二节 市场与交易制度

第三节 价差模型

第四节 相关理论研究综述

第五节 其他重要概念

第三章 连续做市商市场中的价格行为

第一节 引言

第二节 麦德哈范同质偏好模型

第三节 异质偏好模型

附录 本章命题数字证明

第四章 竞价市场中的价格行为

第一节 引言

第二节 异质偏好模型

第三节 连续竞价市场均衡

第四节 集合竞价市场均衡

第五节 交易制度的比较

附录 本章命题数学证明

第五章 做市商的定价策略分析

第一节 引言

第二节 模型

第三节 连续价格变动下的做市商策略

第四节 离散价格限制下的做市商策略

第五节 数值模拟

第六章 机构投资者的交易策略分析

第一节 引言

第二节 拉丰 - 马斯金模型

第三节 垄断机构投资者与散户博弈

第四节 寡头垄断机构投资者与散户

第五节 市场有效性和无效性的进一步讨论

第六节 本章小结

第七章 交易制度与交易策略

第一节 引言

第二节 信息、策略集与交易策略

第三节 交易制度与交易策略

第四节 不完全竞争下的策略与价格行为

第五节 本章小结

第八章 买卖价差经验研究( )

第一节 引言

第二节 买卖报价价差估计方法

第三节 实证结果及分析

第九章 买卖价差经验研究( )

第一节 引言

第二节 交易发起方指标估计法

第三节 实证结果及分析

第十章 买卖价差经验研究( )

第一节 引言

第二节 联合估计方法

第三节 实证结果及分析

第十一章 结束语

第一节 主要结论

第二节 启示

参考文献

后记

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>