

<<沪深300股指期货>>

图书基本信息

书名：<<沪深300股指期货>>

13位ISBN编号：9787802342262

10位ISBN编号：7802342260

出版时间：2008-5

出版时间：中国发展出版社

作者：陶佶

页数：279

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>

<<沪深300股指期货>>

内容概要

本书是“金融前沿丛书”之一，全书共九章分为三部分：第一部分为期货篇，包括第1章到第3章，全面介绍期货和金融期货的基础知识；第二部分为股指期货篇，包括第4章到第6章，详细介绍股票指数的编制方法、股指期货的合约内容和股指期货的风险管理；第三部分为股指期货投资篇，包括第7章到第9章，在简介投资理论和金融统计的基础上，具体分析如何利用股指期货进行套期保值和套利交易。

该书可供各大专院校作为教材使用，也可供从事相关工作的人员作为参考用书使用。

<<沪深300股指期货>>

作者简介

陶佶，江苏无锡人，现为上海财经大学经济学院特聘副教授兼高等研究院研究员。

1995年获南开大学学士学位；1995-1997年于厦门大学旅游系任教；1997年赴美国留学，2005年8月获美国Ohio State University经济学博士学位。

2005年开始于上海财经大学经济学院担任教学和研究工作。

研究领域包括应用微观计量学和高频金融计量学。

目前从事的研究项目是上海金融期货市场统计套利策略的理论和实证分析，获得2007年上海市浦江人才计划经费资助。

近年来在国外刊物上发表学术论文多篇。

<<沪深300股指期货>>

书籍目录

前言第1章 期货概述 1.1 现代期货市场的产生 1.2 期货合约的交易 1.3 期货交易者的类型 1.3.1 期货套期保值 (1) 套期保值的基本原理 (2) 套期保值的类型 (3) 基差 1.3.2 期货投机交易 (1) 头寸交易者 (position trader) (2) 当日交易者 (day trader) (3) 小投机者 (scalper) 1.3.3 期货套利交易 (1) 跨交割月份套利 (跨期套利) (2) 跨市场套利 (跨市套利) (3) 跨商品套利 1.4 期货交易与现货交易、远期交易的关系 1.5 国内外商品期货市场现状第2章 金融期货概述 2.1 金融期货的产生和发展 2.1.1 国际金融期货的产生和发展 (1) 外汇期货的产生和发展 (2) 利率期货的产生和发展 2.1.2 我国金融期货及其市场的发展情况 (1) 我国外汇期货试点情况 (2) 我国利率期货试点情况 (3) 我国股指期货的仿真交易 2.2 金融期货的交易者 2.2.1 套期保值 (1) 套期保值原理 (2) 套期保值的基本做法 2.2.2 套利交易 2.2.3 投机交易 (1) 多头投机交易 (2) 空头投机交易 2.3 金融期货合约 2.4 金融期货交易基础知识 2.4.1 金融期货交易的特征 2.4.2 金融期货交易指令 (1) 按价格限制范围来划分 (2) 按指令执行时间来划分 2.4.3 金融期货交易行情表解析第3章 金融期货市场 3.1 金融期货市场结构第4章 股票指数第5章 股指期货合约设计第6章 股指期货风险管理第7章 金融统计和投资理论第8章 股指期货套期保值第9章 股指期货套利结语参考文献

<<沪深300股指期货>>

章节摘录

第1章 期货概述 1.1 现代期货市场的产生 期货 (futures) 是期货合约的简称。

期货市场最早萌芽于欧洲, 期货交易的历史可以追溯到中古时代的远期交易。

在古希腊和古罗马时期, 曾出现过远期或期货性质的大宗货物交易活动。

中世纪后期, 随着西欧等国商品经济的发展和国际贸易的增长, 这种远期或期货交易的市场机制得到进一步发展和完善。

1848年美国芝加哥商会的成立标志着现代意义上的期货市场的诞生。

最初的期货交易是基于商人和农民在交易农产品时为了消除彼此面临的价格风险而发展起来的。

假设下述这种情况: 东北一个大豆种植户在某一年的4月已经知道他在9月份将收获多少吨大豆。

但是如果在现货市场上出售大豆, 他所面临的价格通常是不确定的: 在丰收的年份大豆的价格可能会走低; 但在歉收的年份这个价格可能会很高。

这样这个农户当年的家庭收入将面临很大的风险。

再假设下述这种情况: 南方一家豆制品公司对大豆有长期的需求, 这家公司面临同样的价格风险

。在丰收的年份大豆价格可能会走低; 但在歉收的年份这个价格可能会很高。

因此对于这位农户和这家公司来说, 在大豆种植季节或者更早的时候达成协议, 确定该农户在9月份收割的大豆成交价格, 对于双方而言都是十分有利的。

换句话说, 农户和公司通过签订一份远期或期货合约可以消除交易双方由于未来大豆价格的不确定性而面临的风险。

1848年3月13日美国芝加哥市82位谷物商人在市中心南水街上的一家面粉店里创建了芝加哥商会。

这家商会是世界上公认的第一家现代期货交易所——芝加哥期货交易所的前身。

芝加哥期货交易所和现代期货市场的历史也就从这一天开始。

当时, 商会的主要任务是标准化所交易的谷物的数量和质量, 从而为农民和商人间的谷物交易提供便利。

.....

<<沪深300股指期货>>

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>