



- 新闻中心 NEWS&EVENTS
- 学院概况 ABOUT US
- 师资队伍 TEACHERS
- 科学研究 ACADEMIC RESEARCH
- 本科生培养 UNDERGRADUATE EDUCATION
- 研究生培养 POSTGRADUATE EDUCATION
- 国际合作 INTERNATIONAL COOPERATION
- 学生天地 STUDENTS AFFAIRS
- 校友服务 ALUMNI



## 思想库

Think Tanks

- > 学术论文 | Academic Papers
- > 著作推荐 | Book Recommendation
- > 专家观点 | Expert View
- > 教授讲坛 | Faculty&Forum
- >> 返回科学研究



教师博客  
Teacher's Blog

- 孙立坚 陈 钊 范剑勇
- 华 民 李维森 陆 铭
- 王永钦 袁志刚 张 军
- 寇宗来

## 著作推荐

首页 > 科学研究 > 思想库 > 著作推荐



宋军：《期货市场的定价、行为模式和制度研究》

发布时间：2012-11-20 00:00:00 浏览次数：363

作者简介：宋军，复旦大学经济学院国际金融系副教授，系主任；一亡海金融工程学会理事；深圳证券交易所和中国社会科学院金融研究所应用经济学博士后；上海交通大学管理科学与工程学博士。主要研究方向为行为金融、资产定价和金融工程。已承担国家自然科学基金、教育部人文社会科学基金等多个项目，在《金融研究》、《经济研究》、《管理科学学报》等期刊发表论文几十篇，出版专著一本。为《管理科学学报》、《上海交通大学学报》、《系统管理学报》和《中国金融评论》等多个期刊的匿名审稿人。

### 目录

#### 第一章 序言

- 1.1 快速发展的中国期货市场
- 1.2 期货市场的价值基础
- 1.3 本书的主要内容

#### 第二章 基于风险溢价的期货定价理论

- 2.1 研究基础
- 2.2 理论基础
- 2.3 数值计算

#### 第三章 商品期货的风险溢价研究

- 3.1 风险溢价转移效应
- 3.2 研究前提和研究假设
- 3.3 套期保值策略的构造
- 3.4 模拟结果和分析
- 3.5 结论和讨论

#### 第四章 股指期货的风险溢价研究

- 4.1 国内外主要股指期货市场与合约概况
- 4.2 参数设置与数据来源
- 4.3 风险溢价的计算结果
- 4.4 模拟套期保值策略结果分析

## 第五章 风险溢价的季节效应

- 5.1 引言
- 5.2 研究假设
- 5.3 计算结果和分析
- 5.4 政策建议
- 5.5 结论和讨论

## 第六章 套期保值的模式识别

- 6.1 引言
- 6.2 研究背景
- 6.3 研究方法
- 6.4 实证结果和分析
- 6.5 总结与讨论

## 第七章 风险溢价对成交量和波动性的影响

- 7.1 不对称关系
- 7.2 数据
- 7.3 实证结果
- 7.4 结论与扩展

## 第八章 逼仓识别和保证金设置

- 8.1 研究背景
- 8.2 逼仓动机分析
- 8.3 实证检验方法
- 8.4 数据来源和处理
- 8.5 实证结果
- 8.6 保证金设置与逼仓风险预警方法研究
- 8.7 总结与讨论

## 第九章 基于权重股的股指期货的操纵模式研究

- 9.1 引言
- 9.2 数据说明
- 9.3 模型构建及参数估计
- 9.4 结论分析

## 第十章 期铜市场的国际跨市套利

- 10.1 背景
- 10.2 SHFE期铜引导LME期铜和跨市套利
- 10.3 跨市套利头寸的分布特征
- 10.4 内盘在远月合约上的对手盘
- 10.5 结论

## 第十一章 保证金的绩效研究

- 11.1 引言
- 11.2 研究背景
- 11.3 我国期货交易的两类保证金调整
- 11.4 事件研究法
- 11.5 结构向量自回归模型 (SVAR)
- 11.6 总结和讨论

## 第十二章 沪深300股指期货最优结算窗口设计

- 12.1 引言
- 12.2 研究背景
- 12.3 方法

12.4数据

12.5结果和分析

12.6结论

### 第十三章 期权加油卡

13.1背景

13.2期权加油卡的产品设计和运作模式

13.3期权加油卡的定价

13.4期权加油卡的套期保值策略

13.5结论和讨论

参考文献

---