

# 《投资者订单提交行为、订单簿特征与数量化交易研究》

## 书籍信息

版次：1

页数：

字数：

印刷时间：2012年05月01日

开本：12k

纸张：胶版纸

包装：平装

是否套装：否

国际标准书号ISBN：9787514115246

## 内容简介

证券市场的交易机制主要可以分为报价驱动市场（Quote-driven Market）和订单驱动市场（Order-driven Market）两类。报价驱动市场依靠做市商提供流动性，订单驱动市场则依靠限价订单提供流动性。投资者掌握市场信息的质与量、订单簿透明度以及投资者的交易需求目标都会影响投资者订单提交策略和行为，进而影响市场上订单簿构成与变化，最终影响价格发现过程和市场质量。《投资者订单提交行为、订单簿特征与数量化交易研究》旨在从理论与实证两个角度研究中国股市限价订单簿特征、分布和订单提交策略及行为，并在此基础上分析订单簿透明度的影响、订单执行成本（交易成本）等与订单相关的重要问题，最后介绍了数量化交易的理论与实践等内容。

## 目录

### 第一章 引言

### 第二章 文献综述

#### 第一节 投资者订单提交策略和行为的理论

#### 第二节 投资者订单提交策略和行为的实证研究

#### 第三节 投资者订单选择的实证研究

#### 第四节 限价订单簿特征与形状

#### 第五节 限价和市价订单的绩效及对市场的影响

### 第三章 订单类型、订单传输与撮合

#### 第一节 主要订单种类

#### 第二节 订单撮合与价格形成

#### 第三节 中国股市订单报盘系统

#### 第四节 中国股市订单特征与概况

#### 第五节 美国股票市场订单处理

[显示全部信息](#)

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www.tushupdf.com](http://www.tushupdf.com)