

期货学位论文分析报告

Futures academic paper analysis report

方建勇¹（余姚，浙江 315400）

摘要：通过超星发现系统，我们大致了解到期货学位论文所涉及的相关领域，可以明确地判断出哪些高校院所发表的学位论文较多，为我们从事期货相关算法应用做了比较好的指引。

关键词：期货 算法 学位论文 开源项目 分析报告

Abstract: Through the superstar discovery system, we generally understand the relevant fields involved in the Futures academic papers, and can clearly determine which college dissertations publish more academic dissertations and provide a better guide for us to engage in Futures applications.

Key words: Futures; Academic Papers; Open Source Projects; Analysis Reports

期货（Futures）与现货完全不同，现货是实实在在可以交易的货（商品），期货主要不是货，而是以某种大众产品如棉花、大豆、石油等及金融资产如股票、债券等为标的标准化可交易合约。因此，这个标的物可以是某种商品（例如黄金、原油、农产品），也可以是金融工具。

交收期货的日子可以是一星期之后，一个月之后，三个月之后，甚至一年之后。

买卖期货的合同或协议叫做期货合约。买卖期货的场所叫做期货市场。投资者可以对期货进行投资或投机。²

一、期货学术发展趋势

表 1 期货学术发展趋势

¹ 方建勇，男，1978 年-，美国电气电子工程师学会 IEEE 会员，美国计算机学会 ACM 会员，中国工业与应用数学学会会员，中国计算机学会会员，中国中文信息学会会员，中国物流学会会员，浙江大学数学与应用数学专业毕业，MachineCoastline（机器海岸线）CEO&Founder。

² 参考百度期货词条。

期货-学位论文学术发展趋势		
序号	年代	数量(全部命中)
1	1975	1
2	1976	0
3	1977	1
4	1978	1
5	1979	0
6	1980	0
7	1981	0
8	1982	0
9	1983	2
10	1984	2
11	1985	0
12	1986	4
13	1987	2
14	1988	1
15	1989	5
16	1990	2
17	1991	4
18	1992	0
19	1993	10
20	1994	34
21	1995	43
22	1996	48
23	1997	43
24	1998	52
25	1999	45
26	2000	44
27	2001	91
28	2002	105
29	2003	139
30	2004	121
31	2005	173
32	2006	289
33	2007	373
34	2008	468
35	2009	425
36	2010	420
37	2011	630

38	2012	552
39	2013	509
40	2014	447
41	2015	369
42	2016	359
43	2017	222
44	2018	0

二、期货成果统计³

1、关键词

关键词涉及股指期货(1393⁴)、期货市场(716)、套期保值(626)、价格发现(403)、期货(382)、风险管理(293)、波动性(269)、Garch 模型(255)、期货交易(155)、期货公司(138)、风险控制(136)、套利(132)、期货价格(112)、商品期货(107)、风险(106)、协整检验(102)、股票市场(100)、现货市场(100)、流动性(98)、Var(98)、沪深 300 指数(87)、股票指数期货(85)、协整(81)、误差修正模型(79)、var 模型(75)、保证金(72)、金融市场(67)、Garch(60)、股票指数(58)、金融期货(57)、市场有效性(52)、证券市场(51)、GRANGER 因果检验(48)、极值理论(48)、监管(47)、价格波动(45)、期货合约(43)、期货交易所(42)、可行性(40)、实证分析(40)、ETF(40)、现货价格(39)、投机(38)、市场风险(35)、有效性(34)、投资策略(34)、技术分析(33)、投资组合(33)等。

³ 数据来源于超星发现系统。

⁴ 括号内数字为出现频次，下同。



图 1 期货学位论文关键词频次泡型图

2、学位论文所在高校院所分布

学位论文所在高校院所依次为中国人民大学(312)、对外经济贸易大学(243)、西南财经大学(219)、复旦大学(216)、上海财经大学(216)、中国农业大学(178)、上海交通大学(163)、厦门大学(155)、北京大学(125)、东北财经大学(125)、中山大学(117)、吉林大学(110)、中央财经大学(100)、武汉大学(96)、华中科技大学(94)、淡江大学(93)、湖南大学(90)、浙江大学(84)、首都经济贸易大学(82)、西安交通大学(82)、山东大学(81)、华东师范大学(78)、南开大学(75)、暨南大学(71)、天津大学(70)、中南大学(69)、中南工业大学(40)、哈尔滨工业大学(67)、大连理工大学(66)、华南理工大学(61)、浙江工商大学(60)、台湾大学(56)、南京大学(54)、北京工商大学(53)、辽宁大学(46)、北京航空航天大学(45)、同济大学(45)、江西财经大学(45)、清华大学(44)、云南大学(44)、西南交通大学(39)、南京财经大学(38)、中国科学技术大学(37)、华中师范大学(34)、中国社会科学院(34)、天津财经大学(33)、华东理工大学(32)、山西财经大学(31)、北京理工大学(30)等。



图 2 期货学位论文所在高校院所频次泡型图

3、学位论文成果（博士学位论文）

表 2 学位论文成果

[学位论文] 基于“价格泡沫”视角的农产品期货市场风险评价、传导与预警研究

作者：李剑（华中农业大学）

学位名称：博士

出处：华中农业大学 2017

关键词：农产品价格；农产品期货；风险评价；风险传导；风险预警；价格泡沫

[学位论文] 期货市场操纵的法律规制

作者：钟维（中国人民大学）

学位名称：博士

出处：中国人民大学 2016

关键词：市场操纵；期货；衍生品；跨市场；法律规制

[学位论文] 动力煤期货价格预测与最优套期保值比率模型研究 引证(3)

作者：张耕菩（中国矿业大学(北京)）

学位名称：博士

出处：中国矿业大学(北京) 2016

关键词：动力煤期货；预测模型；最优套期保值比率；合约

[学位论文] 天然气期货影响因素及定价模型研究

作者：邢文婷（重庆大学）

学位名称：博士

出处：重庆大学 2016

关键词：天然气期货；Copula 函数；跳跃过程；季节性；随机贴现因子

[学位论文] 期权与期货的几种定价新方法研究

作者：郭姝辛（西南财经大学）

学位名称：博士

出处：西南财经大学 2016

[学位论文] 我国股指期货运行状况和功能发挥研究

作者：燕志鹏（浙江大学）

学位名称：博士

出处：浙江大学 2016

[学位论文] 期货时间序列复杂网络特征与投资组合策略研究

作者：王楠（中国地质大学(北京)）

学位名称：博士

出处：中国地质大学(北京) 2016

关键词：复杂网络；期货市场；投资组合；关系结构；量化交易

[学位论文] 基于多主体仿真的原油期货市场交易策略优选研究

作者：王利军（中国地质大学(北京)）

学位名称：博士

出处：中国地质大学(北京) 2016

关键词：原油期货；交易策略；优选；多主体建模；模拟仿真

[学位论文] 中国期货市场的风险管理与资产配置功能研究——基于极端事件和尾部风险的视角

作者：梁巨方（厦门大学）

学位名称：博士

出处：厦门大学 2016

关键词：股指期货；流动性；尾部风险

[学位论文] 中国股票与股指期货跨市场交易系统性风险研究

作者：武毅（天津财经大学）

学位名称：博士

出处：天津财经大学 2016

关键词：股票市场；股指期货市场；跨市场交易；系统性风险；风险；预警指标体系

[学位论文] 大宗商品期货定价机制研究——基于中国大豆进口商的最优套保比改进

作者：裴勇（中国人民大学）

学位名称：博士

出处：中国人民大学 2016

关键词：大宗商品；期货定价；基差风险；套期保值比例；套保效果

[学位论文] 金融投资者行为及其对股票与期货市场的影响研究

作者：王晓琳（哈尔滨工业大学）

学位名称：博士

出处：哈尔滨工业大学 2016

关键词：投资者关注；搜索量指数；分析师意见分歧；领先滞后关系；季节效应；指令失衡

[学位论文] 沪深 300 股价指数与指数期货间之非线性动态调整交易行为之探讨

作者：邹易凭（淡江大学）

学位名称：博士

出处：淡江大学 2016

关键词：沪深 300 股价指数；平滑转换向量差修正模型；价格发现；回馈交易；流动性交易动性；资讯交易动性

[学位论文] 基于情绪的股指期货定价研究 引证(2)

作者：高斌（华南理工大学）

学位名称：博士

出处：华南理工大学 2015

关键词：股指期货价格；股指期货情绪；沪深 300 股票情绪；定价错误；行为金融

[学位论文] 股指期货、期权功能的动态研究——基于时变性的价格发现、波动溢出、隐含波动率实证分析

作者：杨东晓（山东大学）

学位名称：博士

出处：山东大学 2017

关键词：股指期货；期权；功能；动态研究；时变性；价格发现；波动溢出；隐含波动率

[学位论文] 中国股票指数期货市场的功能实证研究 引证(4)

作者：季宇（吉林大学）

学位名称：博士

出处：吉林大学 2015

关键词：股指期货市场；价格发现；套期保值效率；价格引导；波动性；流动性

[学位论文] 期货大宗商品价格波动的差异性研究——以大豆、铜和原油为例 引证(1)

作者：王倩（中国农业大学）

学位名称：博士

出处：中国农业大学 2015

关键词：期货；大宗商品；价格波动；差异性

[学位论文] 我国股指期货市场效率的实证研究 引证(11)

作者：王继莹（吉林大学）

学位名称：博士

出处：吉林大学 2014

关键词：股指期货市场；效率；信息效率；流动性；价格发现；套期保值

[学位论文] 期货公司合规法律制度研究

作者：谢甜甜（对外经济贸易大学）

学位名称：博士

出处：对外经济贸易大学 2015

关键词：合规；期货公司；公司治理

[学位论文] 境内外 A 股股指期货市场功能差异性研究

作者：范泰奇（中央财经大学）

学位名称：博士

出处：中央财经大学 2015

关键词：股指期货；价格发现；套期保值；差异性研究

[学位论文] 开放条件下原油期货市场的风险管理与监管研究

作者：罗剑（上海社会科学院）

学位名称：博士

出处：上海社会科学院 2015

关键词：期货市场；原油期货；风险管理；极值理论；投机；套利；投资者适当性交易编码；内幕交易；跨市场监管；跨境监管；全球治理

[学位论文] 基于交易信息的期货市场操纵识别研究

作者：蒋云鹤（上海交通大学）

学位名称：博士

出处：上海交通大学 2015

[学位论文] 中国商品期货市场与股票市场之间交互 定价研究

作者：石智超（对外经济贸易大学）

学位名称：博士

出处：对外经济贸易大学 2015

[学位论文] 全球主要期货交易所公司化研究

作者：罗大敏（东北财经大学）

学位名称：博士

出处：东北财经大学 2015

关键词：期货交易所；公司化；国际比较；动因；路径

[学位论文] 无套利价格原理下的期货套期保值研究

作者：张海雷（厦门大学）

学位名称：博士

出处：厦门大学 2015

关键词：无套利原理；套保比率；持有成本

[学位论文] 我国股指期货市场极端风险度量与防范研究

作者：赖文炜（上海财经大学）

学位名称：博士

出处：上海财经大学 2015

[学位论文] 我国主要商品期货的价格波动与避险效应研究

作者：吴晓雄（西南交通大学）

学位名称：博士

出处：西南交通大学 2015

[学位论文] H 股股指期货与股指期货套利研究

作者：吕家彦（上海财经大学）

学位名称：博士

出处：上海财经大学 2015

[学位论文] 我国商品期货和股票期权定价的若干模型研究

作者：赵强（上海财经大学）

学位名称：博士

出处：上海财经大学 2015

[学位论文] 股指期货市场交易行为信息差异及其影响研究

作者：剡亮亮（上海财经大学）

学位名称：博士

出处：上海财经大学 2015

[学位论文] 基于企业社会责任视角的期货公司风险管理研究 引证(10)

作者：刘红（山西财经大学）

学位名称：博士

出处：山西财经大学 2014

关键词：期货公司；企业社会责任；风险管理

[学位论文] 中国股指期货与现货间信息传导与交互作用的研究

作者：王朝友（哈尔滨工业大学）

学位名称：博士

出处：哈尔滨工业大学 2016

关键词：股指期货；信息传递；波动性结构；基差；价格稳定因素；涨跌停制度

[学位论文] 国际原油期货、现货价格互动引起现货价格泡沫研究

作者：姚小剑（西安理工大学）

学位名称：博士

出处：西安理工大学 2016

关键词：国际原油；期货现货价格互动；现货价格泡沫；便利收益；原油金融

[学位论文] 股指期货市场的定价、功能和风险监管研究：以中国股指期货为例的分析 引证(2)

作者：林复东（南开大学）

学位名称：博士

出处：南开大学 2014

关键词：股指期货；一般均衡；价格发现；风险监管

[学位论文] 我国商品期货国际定价影响力分类比较研究 引证(4)

作者：李自学（中国农业大学）

学位名称：博士

出处：中国农业大学 2014

关键词：商品期货；国际定价；影响力；分类比较；SVAR 模型；成交量；
关键因素

[学位论文] 股指期货及其交易机制调整对期现市场的影响研究 引证(3)

作者：饶越（西南财经大学）

学位名称：博士

出处：西南财经大学 2014

关键词：股指期货；交易机制调整；持仓限额制度；市价指令；市场微
观结构

[学位论文] 中国股指期货市场功能实证研究与优化对策 引证(21)

作者：顾京（华东师范大学）

学位名称：博士

出处：华东师范大学 2013

关键词：股指期货；价格发现；波动性；到期日效应；套期保值

[学位论文] 中国黄金期货价格波动及风险管理研究

作者：何镇宇（云南大学）

学位名称：博士

出处：云南大学 2014

[学位论文] 基于风险：收益模型的油脂期货价差套利研究

作者：王百超（大连理工大学）

学位名称：博士

出处：大连理工大学 2014

关键词：风险-收益模型；油脂期货；价差套利；风险控制

[学位论文] 我国国债期货市场风险和流动性风险管理研究

作者：李凯（中国人民大学）

学位名称：博士

出处：中国人民大学 2014

关键词：市场风险；流动性风险；计量

[学位论文] 股指和股指期货：共同因子、价格发现和波动率研究

作者：郑舒（厦门大学图书馆）

学位名称：博士

出处：厦门大学图书馆 2014

关键词：共同动态因子；价格发现；条件波动率时变相关系数；波动率

溢出

[学位论文] 中国股指期货与股票市场互动关系研究及应用

作者：周舟（中国科学院大学）

学位名称：博士

出处：中国科学院大学 2014

关键词：金融市场；股指期货；套期保值；经济分析

[学位论文] 我国天然橡胶期货市场与现货市场价格关系的研究 引证

(11)

作者：桂俊煜（北京林业大学）

学位名称：博士

出处：北京林业大学 2013

关键词：天然橡胶；现货市场；期货市场；价格关系

[学位论文] 基于高频数据的股指期货微观结构与投资策略研究

作者：余臻（哈尔滨工业大学）

学位名称：博士

出处：哈尔滨工业大学 2014

关键词：股指期货；高频数据；市场微观结构；投资策略；技术分析；
指数套利

[学位论文] 两岸三地期货避险绩效之实证研究

-ARMAX-GJR-GARCH-Copula 模型之应用

作者：李盈仪（厦门大学）

学位名称：博士

出处：厦门大学 2014

关键词：Copula-GJR-GARCH；kendall' stau；optimalhedgeratio

[学位论文] 基于高频数据的沪深 300 股指期货波动率度量方法及应用

引证(10)

作者：任德平（湖南大学）

学位名称：博士

出处：湖南大学 2013

关键词：高频数据；已实现波动率；“跳跃”波动；量价关系；CVaR

[学位论文] 我国股指期货的推出对股票市场波动性影响的研究

作者：皮伟能（上海财经大学）

学位名称：博士

出处：上海财经大学 2014

[学位论文] 基于多重分形理论的中国钢材期货市场非线性特征及套期

保值策略研究

作者：曲红涛（东北大学）

学位名称：博士

出处：东北大学 2014

关键词：商品期货；多重分形；价格预测；套期保值

[学位论文] 基于复杂性理论的中国农产品期货市场非线性动力学特征分析及仿真研究

作者：史纪新（东南大学）

学位名称：博士

出处：东南大学 2014

[学位论文] 我国股指期货功能发挥的实证研究 引证(2)

作者：郭彦峰（西南交通大学）

学位名称：博士

出处：西南交通大学 2013

关键词：沪深 300 指数期货；价格发现；套期保值；投机；程式化交易

[学位论文] 股指期货创新与证券市场监管研究 引证(6)

作者：袁朝阳（华中师范大学）

学位名称：博士

出处：华中师范大学 2013

关键词：股指期货；金融创新；跨市场风险；证券市场监管

[学位论文] 国债期货价格发现功能研究 引证(9)

作者：王震（西南财经大学）

学位名称：博士

出处：西南财经大学 2013

关键词：国债期货；价格发现；波动溢出；市场微观结构；信息份额

[学位论文] 基于行为金融学的股指期货投资者行为研究 引证(4)

作者：沈骏（西南财经大学）

学位名称：博士

出处：西南财经大学 2013

关键词：沪深 300 指数期货；行为金融；处置效应；过度自信；过度反

应实证分析；投资者行为

[学位论文] 中国期货市场个人投资者行为研究 引证(1)

作者：许志（西南财经大学）

学位名称：博士

出处：西南财经大学 2013

关键词：个人投资者；行为金融学；处置效应；框架效应；期货市场

[学位论文] 碳交易期货市场的构建与运行机制研究 引证(1)

作者：苏蕾（东北林业大学）

学位名称：博士

出处：东北林业大学 2013

关键词：碳期货；碳交易市场；运行机制；保障体系

[学位论文] 农户与农产品期货市场对接模式研究 引证(5)

作者：谢长伟（河南农业大学）

学位名称：博士

出处：河南农业大学 2013

关键词：期货市场；农户；对接模式；套期保值

[学位论文] 我国农产品期货市场运行绩效及提升策略研究 引证(5)

作者：李新建（华中农业大学）

学位名称：博士

出处：华中农业大学 2013

关键词：农产品期货市场；运行绩效；涉农企业；波动性；流动性；有效性；提升策略

[学位论文] 中国商品期货定价理论及其实证研究 引证(7)

作者：孙文松（华中科技大学）

学位名称：博士

出处：华中科技大学 2013

关键词：商品期货定价；套期保值压力；标的稀缺性；风险溢价模型；便利收益模型

[学位论文] 中国股指期货市场操纵及其对市场功能的影响研究 引证(7)

作者：左顺根（华南理工大学）

学位名称：博士

出处：华南理工大学 2013

关键词：股指期货；市场操纵；价格发现；套期保值

[学位论文] 外部多空事件对股指现货与期货间价格关联性影响与实证研究：以台湾、香港地区为例 引证(2)

作者：苏乐生（南开大学）

学位名称：博士

出处：南开大学 2013

关键词：协整检验；Granger 因果检验；脉冲响应分析；方差分解分析；套利交易

[学位论文] 中国证券与期货市场微观结构研究：交易费用改变对市场微观结构影响的实证研究 引证(4)

作者：张睿（西南财经大学）

学位名称：博士

出处：西南财经大学 2013

关键词：市场微观结构；买卖价差；交易量；价格波动率；联立方程模型

[学位论文] 期货报酬关联结构与动态风险值评估之研究－台指期货与摩根台指期货为例

作者：李升伦（国立高雄第一科技大学）

学位名称：博士

出处：国立高雄第一科技大学 2013

关键词：动态；情绪；领先-落後关系；台湾股票指数期货；Skewed；Student-t；GARCH；杠杆效果

[学位论文] 中国商品期货套期保值研究

作者：黄晓艳（中山大学）

学位名称：博士

出处：中山大学 2013

关键词：商品期货；套期保值；最优套期保值比率；套期保值的有效性

[学位论文] 台股指数现货和近月期货、次近月期货与选择权的基差及价差行为之研究

作者：游忠儒（台北大学）

学位名称：博士

出处：台北大学 2013

关键词：基差；价差；ANST-GARCH；Put-Call；Parity；指数选择权

[学位论文] 股指期货与资产配置——基于沪深 300 股指期货的实证研究

作者：ANNADEZHENZHU（厦门大学图书馆）

学位名称：博士

出处：厦门大学图书馆 2013

关键词：股指期货；资产配置；套期保值；阿尔法策略；套利

[学位论文] 我国期货市场统一结算体系研究——基于期货结算机构设置视角

作者：李团团（中国农业大学）

学位名称：博士

出处：中国农业大学 2013

关键词：期货结算；期货结算机构设置；风险控制；GARCH-VaR 模型；
压力风险估计

[学位论文] 基于沪深 300 股指期货的投资策略研究

作者：邓雨来（中国科学院大学）

学位名称：博士

出处：中国科学院大学 2013

[学位论文] 商品期货投资及其资产配置方法研究

作者：王凯（复旦大学）

学位名称：博士

出处：复旦大学 2013

关键词：资产配置；商品期货投资；均值方差；风险管理

[学位论文] 中国股指期货与股票现货信息传递效应的数量研究 引证

(11)

作者：罗泊（西南财经大学）

学位名称：博士

出处：西南财经大学 2012

关键词：股指期货市场；股票现货市场；数量研究

[学位论文] 中国黄金期货市场波动特征及风险研究 引证(24)

作者：王兆才（复旦大学）

学位名称：博士

出处：复旦大学 2012

关键词：中国黄金期货市场；交易量；持仓量；ARIMA 模型；GJR-GARCH
模型；MCMC；MRS—GARCH 模型；误差修正模型；脉冲响应函数；VaR 方法；

半参数法

[学位论文] 股票和股指期货跨市场监管法律制度研究 引证(10)

作者：王小丽（安徽大学）

学位名称：博士

出处：安徽大学 2012

关键词：股指期货；股票市场；风险管理；跨市场监管；法律制度

[学位论文] 股指期货市场风险管理与量化策略研究 引证(15)

作者：蒋勇（中国科学技术大学）

学位名称：博士

出处：中国科学技术大学 2012

关键词：股指期货；变结构协整检验；均值回复机制；波动率准则；

TDAR-VaR 估计；高维变量选择

[学位论文] 中国股指期货市场微观结构特征与交易策略研究

作者：姜力（中国人民大学）

学位名称：博士

出处：中国人民大学 2013

关键词：股指期货；高频数据；微观结构

[学位论文] 金融期货交易对现货市场信息效率和市场波动的影响研究

作者：王宇超（南京大学）

学位名称：博士

出处：南京大学 2013

关键词：指数期货；市场波动；信息效率；预期均衡；随机波动

[学位论文] 中国商品期货价格指数编制及其信息传递效应研究

作者：李文（上海财经大学）

学位名称：博士

出处：上海财经大学 2013

[学位论文] 股指期货跳跃与动态套期保值：基于沪深 300 高频数据的研究

作者：任光宇（北京航空航天大学）

学位名称：博士

出处：北京航空航天大学 2013

关键词：跳跃行为；高频数据；跳跃溢出；市场信息；跳跃套期保值

[学位论文] 商品期货实物交割选择权分析及影响研究：以大连商品交易所为例

作者：陈伟（大连理工大学）

学位名称：博士

出处：大连理工大学 2013

关键词：选择权；期货；交割；市场效率

[学位论文] 中国股指期货市场上投资者异质性及其投资策略研究

作者：刘岚（湖南大学）

学位名称：博士

出处：湖南大学 2013

关键词：股指期货市场；投资者异质性；投资者情绪；非理性反应；均衡解析模型

[学位论文] 期货市场微观基础研究 引证(5)

作者：纪彤国（东北财经大学）

学位名称：博士

出处：东北财经大学 2012

关键词：期货；微观基础；套期保值；流动性；波动性

[学位论文] 中国玉米期货市场微观结构与信息溢出效应研究 引证(3)

作者：陈继兵（沈阳农业大学）

学位名称：博士

出处：沈阳农业大学 2012

关键词：玉米期货市场；市场微观结构；信息溢出效应；流动性；交易费用

[学位论文] 融资融券交易下股指期货市场功能的时变性研究 引证(3)

作者：林祥友（西南财经大学）

学位名称：博士

出处：西南财经大学 2012

关键词：融资融券；股指期货；套期保值；期现套利；价格发现；时变性

[学位论文] 沪深 300 股指期货价格发现、定价偏差及波动率研究 引证

(1)

作者：乔高秀（西南财经大学）

学位名称：博士

出处：西南财经大学 2012

关键词：沪深 300 指数；股指期货；价格发现；定价偏差；波动率

[学位论文] 关于中国股指期货的相关问题研究：波动性影响、价格发现与到期日效应 引证(3)

作者：赵莹（南开大学）

学位名称：博士

出处：南开大学 2012

关键词：股指期货；价格发现；波动性；到期日效应

[学位论文] 股指期货结算风险管理研究

作者：李银华（中国科学院大学）

学位名称：博士

出处：中国科学院大学 2012

[学位论文] 我国商品期货价格合理性研究

作者：刘鹏（上海财经大学）

学位名称：博士

出处：上海财经大学 2012

关键词：商品期货；价格合理性；套保制度；会计准则；市场预期

[学位论文] 沪深 300 股指期货市场特征与功能的实证研究

作者：许自坚（西南交通大学）

学位名称：博士

出处：西南交通大学 2012

关键词：股指期货；定价误差；套利；套期保值

[学位论文] 商品期货市场的机构投资者研究：以美国为例

作者：崔明（上海财经大学）

学位名称：博士

出处：上海财经大学 2012

[学位论文] 中国股指期货市场有效性及相关实证问题研究

作者：刘骁毅（上海财经大学）

学位名称：博士

出处：上海财经大学 2012

[学位论文] 中国股指期货市场价格发现和监管问题研究

作者：梁忠辉（东北财经大学）

学位名称：博士

出处：东北财经大学 2012

关键词：股指期货；波动性；领先滞后关系；市场操纵；监管

[学位论文] 我国股指期货市场运行特征与基本功能研究

作者：李婷（中央财经大学）

学位名称：博士

出处：中央财经大学 2012

[学位论文] 股指期货对股票现货市场波动影响研究

作者：赵新奎（中国社会科学院研究生院；中国社会科学院）

学位名称：博士

出处：中国社会科学院研究生院；中国社会科学院 2012

[学位论文] 有关沪深 300 股指期货避险功能之研究

作者：沈文和（上海财经大学）

学位名称：博士

出处：上海财经大学 2012

关键词：指数期货；避险功能；风险管理；资本市场

[学位论文] 我国期货市场定价效率及其影响因素的实证研究

作者：魏振祥（西安交通大学）

学位名称：博士

出处：西安交通大学 2012

关键词：期货市场；定价效率；价格形成机制；交易行为；点价

[学位论文] 基于均值回复效应的中国市场股指期货套利研究

作者：魏卓（中国科学院研究生院）

学位名称：博士

出处：中国科学院研究生院 2012

关键词：沪深 300 股指期货；均值回复；套利；日内效应

[学位论文] 我国燃料油期货价格波动特征、基差期限结构及展期时机选择研究

作者：孟磊（西安交通大学）

学位名称：博士

出处：西安交通大学 2012

关键词：燃料油价格；期现货基差；期限结构；展期基差；展期时机选择

[学位论文] 股票指数期货与现货市场关系研究-基于中国内地与海外市场的比较研究

作者：张一锋（中国农业大学）

学位名称：博士

出处：中国农业大学 2012

关键词：股指期货；股票指数；价格波动；到期日效应；定价效率

[学位论文] 中美期货交易所体制比较研究：基于价格发现功能的分析

作者：赵栋强（中国农业大学）

学位名称：博士

出处：中国农业大学 2012

关键词：交易所体制；价格发现；主力合约；近月合约；向量误差修正模型

[学位论文] 基于职能和属性视角的期货公司发展路径与监管对策研究

作者：欧阳琛（上海财经大学）

学位名称：博士

出处：上海财经大学 2012

[学位论文] 金融市场价格波动的跳跃效应与传染效应研究：以 SHFE 市场金属期货为例

作者：周伟（东南大学）

学位名称：博士

出处：东南大学 2012

[学位论文] 我国股指期货与股票市场的互动影响及跨市场监管研究

作者：唐海仕（中南大学）

学位名称：博士

出处：中南大学 2012

关键词：股指期货；股票市场；市场微观结构；GARCH 模型；Copula 函数；跨市场监管

[学位论文] 投资者结构及其行为视角下中国股指期货市场风险监管机制研究

作者：杨阳（西安交通大学）

学位名称：博士

出处：西安交通大学 2012

关键词：股指期货市场；风险监管机制；投资者结构；投资者情绪；动态差异化

[学位论文] 中国股指期货市场、ETF 市场与股票市场的联动效应研究

作者：张立（厦门大学）

学位名称：博士

出处：厦门大学 2012

[学位论文] 小波转换结合类神经网络於股价预测及价格发现之研究——以香港及中国指数现货与期货对台港两地挂牌 ETF 为例

作者：赖建成（国立高雄第一科技大学）

学位名称：博士

出处：国立高雄第一科技大学 2012

关键词：类神经网络；价格发现；跨境 ETF；小波转换

[学位论文] 股指期货影响股市波动的机制解析与实证检验 引证(36)

作者：蔡向辉（复旦大学）

学位名称：博士

出处：复旦大学 2010

关键词：股指期货；股市波动性；风险管理；价格发现；正反馈交易

[学位论文] 中国黄金期货市场特征及风险控制 引证(10)

作者：陈秋雨（浙江大学）

学位名称：博士

出处：浙江大学 2011

关键词：黄金期货；分形市场；风险控制；极值理论；重现水平；期望

不足

[学位论文] 中国黄金期货市场功能研究 引证(11)

作者：任俊涛（中共中央党校）

学位名称：博士

出处：中共中央党校 2011

关键词：黄金期货；市场功能；套期保值；价格发现

[学位论文] 股指期货的推出对我国股市波动性和流动性的变动影响及
对策研究 引证(2)

作者：黄添勇（厦门大学）

学位名称：博士

出处：厦门大学 2011

关键词：沪深 300 股指期货；波动性；流动性；套期保值

[学位论文] 股指期货交易的私法分析

作者：闫荣涛（中国政法大学）

学位名称：博士

出处：中国政法大学 2011

关键词：股指期货；买卖法律关系；担保法律关系；不法交易行为

[学位论文] 中国期货市场的历史与发展研究 引证(10)

作者：宋承国（苏州大学）

学位名称：博士

出处：苏州大学 2010

关键词：中国；期货市场；历史；发展

[学位论文] 股指期货最优期现套利研究

作者：刘炜亮（武汉大学）

学位名称：博士

出处：武汉大学 2011

关键词：股指期货；期现套利；风险管理

[学位论文] 白糖期货价格与现货价格关系的研究

作者：梅传伟（南开大学）

学位名称：博士

出处：南开大学 2011

[学位论文] 农产品期货定价机制研究：基于玉米期货的实证检验

作者：陈标金（华南农业大学）

学位名称：博士

出处：华南农业大学 2011

关键词：农产品期货；定价机制；投机均衡模型；实证检验

[学位论文] 股指期货对我国股票市场影响的实证研究

作者：顾苏秦（中国人民大学）

学位名称：博士

出处：中国人民大学 2011

关键词：股指期货；价格波动；价格发现过程

[学位论文] 中国期货期权产品创新及其风险管理研究

作者：刘少华（华中科技大学）

学位名称：博士

出处：华中科技大学 2011

关键词：期权合约；风险度量；保证金系统；涨跌停板；风险管理制度

[学位论文] 中国钢材期货套期保值和套利研究

作者：汤乐明（北京科技大学）

学位名称：博士

出处：北京科技大学 2011

关键词：钢材期货；价格发现；套期；套利；成本

[学位论文] 股指期货的非典型性系统风险与监管深化研究

作者：周文和（中国人民大学）

学位名称：博士

出处：中国人民大学 2011

关键词：股指期货；系统性风险；监管

[学位论文] 流动性过剩对中国期货市场影响研究

作者：赵伟雄（东南大学）

学位名称：博士

出处：东南大学 2011

关键词：流动性过剩；期货市场；马歇尔 K 值；真实利率；货币供求；

资产价格

[学位论文] 股指期货交易所风险控制技术和方法研究

作者：刘佳（北京理工大学）

学位名称：博士

出处：北京理工大学 2011

关键词：股指期货；风险；保证金；操纵；价格限制

[学位论文] 中国股指期货套利研究：基于中国证券市场条件下的股指期货套利模型改进与实证研究

作者：赵颖楠（厦门大学）

学位名称：博士

出处：厦门大学 2011

[学位论文] 股指期货市场与股票市场关系的实证研究

作者：肖磊（武汉大学）

学位名称：博士

出处：武汉大学 2011

关键词：股指期货市场；股票市场；流动性；波动率；价格引导；收益性；CSM 探索图

[学位论文] 股指期货套期保值和套利策略研究 引证(23)

作者：梁斌（中国科学技术大学）

学位名称：博士

出处：中国科学技术大学 2010

关键词：股指期货；套期保值；最小角回归；Lasso；可转移 Alpha；持股集中度；SPAN

[学位论文] 我国粮食期货市场与现货市场价格关系的研究 引证(42)

作者：王川（中国农业科学院）

学位名称：博士

出处：中国农业科学院 2009

关键词：粮食；期货市场；现货市场；价格关系

[学位论文] 中国商品期货市场风险管理机制研究 引证(17)

作者：李建良（华中科技大学）

学位名称：博士

出处：华中科技大学 2010

关键词：商品期货；市场风险；风险度量；最优套期保值比；保证金；
风险预警

[学位论文] 全球金融环境下中国商品期货市场金融属性研究

作者：赵峻镭（中国人民大学）

学位名称：博士

出处：中国人民大学商学院 2012

关键词：商品期货；虚拟性；金融属性

[学位论文] 动态差异化的保证金与涨跌停板组合交易机制对期货市场
效应影响的研究

作者：杨光（西安交通大学）

学位名称：博士

出处：西安交通大学 2011

关键词：保证金制度；涨跌停板制度；机构投资者；套期保值；投机；
动态差异化

[学位论文] 期货价差套利研究：跨期、跨市异常价差分析

作者：张晓磊（中国农业大学）

学位名称：博士

出处：中国农业大学 2011

关键词：套利价差；异常点；库存；持有成本；便利收益

[学位论文] 完善我国期货市场风险监控系统的研究：以上期所风险监控
系统为例

作者：黄佐铨（上海交通大学）

学位名称：博士后

出处：上海交通大学 2012

[学位论文] 期货市场风险度量与对冲研究 引证(3)

作者：梁春早（天津大学）

学位名称：博士

出处：天津大学 2011

关键词：风险管理；对冲；铜期货；股指期货

[学位论文] 中国期货市场功能研究 引证(3)

作者：许诺（中共中央党校）

学位名称：博士

出处：中共中央党校 2010

关键词：期货市场功能；风险管理；金融危机；博弈理论；保险市场

[学位论文] 股指期货风险管理研究 引证(26)

作者：罗思远（复旦大学）

学位名称：博士

出处：复旦大学 2009

关键词：股指期货；风险识别；风险度量；风险控制

[学位论文] 我国燃料油期货市场久期及其应用研究 引证(2)

作者：王锋（中国矿业大学）

学位名称：博士

出处：中国矿业大学 2011

关键词：久期；自回归条件久期模型；日内效应；(超)高频数据；日内

VaR

[学位论文] 中国铜期货市场价格相关性与波动性研究 引证(6)

作者：胡玉玺（中南大学）

学位名称：博士

出处：中南大学 2011

关键词：铜资源；铜期货；相关性；Copula 理论；随机过程；风险度量；随机控制；O-U 模型；跳扩散模型；GMM 估计；最优投资策略

[学位论文] 金融危机背景下中国农产品期货市场的价格发现与风险规避研究：以大豆类期货为例 引证(3)

作者：于静淼（沈阳农业大学）

学位名称：博士

出处：沈阳农业大学 2011

关键词：金融危机；农产品期货市场；价格发现；风险规避

[学位论文] 股指期货对股票市场影响的研究 引证(21)

作者：刘考场（湘潭大学）

学位名称：博士

出处：湘潭大学 2009

关键词：股指期货；波动性；流动性；制度设计

[学位论文] 我国商品期货市场效率实证研究 引证(15)

作者：周蓓（哈尔滨工业大学）

学位名称：博士

出处：哈尔滨工业大学 2009

关键词：期货市场；信息效率；随机游走；信息传递

[学位论文] 我国期货公司监管制度体系研究 引证(8)

作者：吴崎右（中国科学技术大学）

学位名称：博士

出处：中国科学技术大学 2010

关键词：期货公司；政府行政监管；自律组织监管；社会中介监督；正式制度；非正式制度

[学位论文] 股指期货与现货市场的相关性及套期保值策略研究 引证(7)

作者：柴尚蕾（大连理工大学）

学位名称：博士

出处：大连理工大学 2011

关键词：股指期货；现货市场；相关性；套期保值

[学位论文] 粮食安全与农产品期货市场发展研究 引证(23)

作者：何蒲明（华中农业大学）

学位名称：博士

出处：华中农业大学 2009

关键词：粮食安全；粮食生产；粮食价格；粮食流通；粮食储备；粮食贸易；农民增收；农产品期货市场

[学位论文] 基于隐性交易成本的期货市场交易策略研究 引证(18)

作者：黄伟（上海交通大学）

学位名称：博士

出处：上海交通大学 2009

关键词：期货市场；交易策略；备用保证金；冲击成本；无套利定价；

逼仓

[学位论文] 中国期货市场波动性与投资者交易行为研究 引证(7)

作者：王郢（华中科技大学）

学位名称：博士

出处：华中科技大学 2010

关键词：投资者行为；市场波动性；市场异象；认知行为偏差

[学位论文] 商品期货市场价格发现与投机泡沫研究 引证(8)

作者：吕永琦（华中科技大学）

学位名称：博士

出处：华中科技大学 2010

关键词：价格发现；波动溢出；便利收益；投机泡沫

[学位论文] 中国油脂期货市场效率研究 引证(12)

作者：李敬（华中农业大学）

学位名称：博士

出处：华中农业大学 2010

关键词：油脂期货市场；效率评价体系；效率不对称；变结构协整；SVAR

模型

[学位论文] 大豆期货价格波动的风险管理研究 引证(19)

作者：赵玉（华中农业大学）

学位名称：博士

出处：华中农业大学 2010

关键词：大豆期货市场；价格波动；风险管理；制度设计

[学位论文] 我国玉米期货价格影响因素与波动特征分析 引证(19)

作者：丁文斌（华中农业大学）

学位名称：博士

出处：华中农业大学 2009

关键词：玉米期货；价格波动；弹性；塑性；V/S 分析

[学位论文] 股指期货套期保值策略理论与应用研究 引证(33)

作者：何晓彬（厦门大学）

学位名称：博士

出处：厦门大学 2008

关键词：股指期货；套期保值；M-GARCH

[学位论文] 铜期货市场的时变价格发现功能和市场信息溢出研究 引证

(1)

作者：芮执多（西安交通大学）

学位名称：博士

出处：西安交通大学 2010

关键词：期货市场；价格发现；时变性；协整；多元 GARCH

[学位论文] 中国股指期货对现货市场的影响研究 引证(26)

作者：张阁（东北财经大学）

学位名称：博士

出处：东北财经大学 2010

关键词：股指期货；现货；传导；波动性；到期日效应；计量经济模型

[学位论文] 我国农产品期货市场功能和效率的实证研究 引证(12)

作者：黄晓千（吉林大学）

学位名称：博士

出处：吉林大学 2010

关键词：农产品期货；价格发现；套期保值

[学位论文] 我国发展电力期货相关问题研究

作者：白青峰（武汉大学）

学位名称：博士

出处：武汉大学 2010

关键词：电力市场；电力期货；套期保值

[学位论文] 股指期货与股指期货配合机理的研究

作者：魏洁（北京航空航天大学）

学位名称：博士

出处：北京航空航天大学 2010

关键词：股指期货；股指期货；流动性；市场效率；信息传递；套期保

值

[学位论文] 恢复国债期货交易的宏观基础研究

作者：范丽君（中国社会科学院）

学位名称：博士后

出处：中国社会科学院 2011

[学位论文] 沪深 300 股指期货保证金设置及套利定价研究

作者：李世伟（浙江大学）

学位名称：博士

出处：浙江大学 2011

关键词：股指期货；保证金设置；套利定价；EWMA 模型

[学位论文] 中国期货市场基差行为与动态套期保值策略研究

作者：陈冲（中国科学院研究生院）

学位名称：博士

出处：中国科学院研究生院 2011

关键词：期货市场；基差行为；风险溢价；尾部行为；极值理论；动态套期保值策略；期望效用

[学位论文] 股指期货期现套利理论、方法及实证研究

作者：张路胶（厦门大学）

学位名称：博士

出处：厦门大学 2010

关键词：沪深 300 指数期货；期现套利；现货组合构造；跟踪误差；套利成本

[学位论文] 我国橡胶期货国际定价影响力研究

作者：陈君（中国农业大学）

学位名称：博士

出处：中国农业大学 2010

关键词：橡胶期货；国际定价；影响力

[学位论文] 中国期货市场流动性影响因素分析及溢价研究

作者：沈虹（东南大学）

学位名称：博士

出处：东南大学 2010

关键词：期货市场；流动性；影响因素；溢价

[学位论文] 台湾期货与股票市场三大法人买卖超行为与报酬之关系及资讯内涵之探讨

作者：黄文芳（国立高雄第一科技大学）

学位名称：博士

出处：国立高雄第一科技大学 2010

关键词：价格之持久性不对称影响；同步买卖超；资讯内涵；资讯假说；个别买卖超

[学位论文] 股权结构、动态能力与企业风险：基于中国期货公司的实证研究

作者：徐根旺（西安交通大学）

学位名称：博士

出处：西安交通大学 2010

关键词：股权结构；股权集中度；股权制衡度；股权性质；动态能力；
企业风险

[学位论文] 农产品市场价格与波动的传递效果：以国际谷物期货价格、
台湾白肉鸡饲料与产地价格之研究

作者：胡惟喻（中兴大学）

学位名称：博士

出处：中兴大学 2010

关键词：传递效果；BEKK--MGARCH 模型；DCC-MGARCH 模型；价格波
动

[学位论文] 股指期货投资问题研究 引证(13)

作者：郭洪钧（西安交通大学）

学位名称：博士

出处：西安交通大学 2008

关键词：股指期货；定价；套期保值；投资战略；领先—滞后关系

[学位论文] 期货市场自律监管制度研究 引证(7)

作者：裴斐（华东政法大学）

学位名称：博士

出处：华东政法大学 2009

关键词：期货市场；自律监管；政府监管；司法介入

[学位论文] 股指期货套利与套期保值研究 引证(32)

作者：张敏（华中科技大学）

学位名称：博士

出处：华中科技大学 2007

关键词：股指期货；定价；期现套利；合约间套利；套期保值

[学位论文] 金融期货市场监管法律制度研究 引证(28)

作者：胡茂刚（华东政法大学）

学位名称：博士

出处：华东政法大学 2008

关键词：金融期货；股指期货；市场失灵；风险控制；跨市场；运作模式；法律监管；政府监管；自律管理

[学位论文] 股指期货标的指数选择研究 引证(1)

作者：彭艳（天津大学）

学位名称：博士

出处：天津大学 2009

关键词：标的指数选择；股指期货；博弈论

[学位论文] 中国商品期货市场效率问题研究 引证(5)

作者：何锋（华中科技大学）

学位名称：博士

出处：华中科技大学 2009

关键词：期货市场效率；无偏预测；量价关系；日历效应；市场操纵；分位回归法；ARDL 边界检验

[学位论文] 基于股指期货的风险管理研究 引证(5)

作者：张龙斌（天津大学）

学位名称：博士

出处：天津大学 2009

关键词：股指期货；完备市场；对冲策略；风险管理

[学位论文] 中国股指期货市场监管研究 引证(8)

作者：陈旭光（东北财经大学）

学位名称：博士

出处：东北财经大学 2010

关键词：股指期货；监管体系；监管制度；合约设计；价格限制

[学位论文] 股指期货功能理论与实证研究 引证(9)

作者：方斌（天津大学）

学位名称：博士

出处：天津大学 2010

关键词：股指期货；价格发现；套期保值；套利；沪深 300 指数

[学位论文] 石油期货市场多重分形特征及相关问题研究 引证(6)

作者：陈洪涛（南京航空航天大学）

学位名称：博士

出处：南京航空航天大学 2009

关键词：石油金融；石油价格；石油期货；多重分形；价格发现；溢出

效应

[学位论文] 现货与期货交易并存的电力市场理论建模与实证研究 引证

(2)

作者：冯伟林（湖南大学）

学位名称：博士

出处：湖南大学 2009

关键词：电力工业；现货市场；期货市场；非劣 Nash 均衡；协整

[学位论文] 引进股指期货对现货市场的影响研究 引证(94)

作者：郭睿（吉林大学）

学位名称：博士

出处：吉林大学 2005

关键词：股指期货市场；现货市场；波动性；流动性；溢出效应

[学位论文] 中国期货交易所公司化改制研究 引证(12)

作者：王亚梅（中国人民大学）

学位名称：博士

出处：中国人民大学 2008

关键词：公司化；期货交易所；治理结构；治理机制；自律

[学位论文] 融资融券交易下的股指期货市场功能研究 引证(4)

作者：林祥友（西南财经大学）

学位名称：博士

出处：西南财经大学 2009

关键词：融资融券交易；股指期货；套期保值；套期图利；价格发现

[学位论文] 商品期货最优套期保值比估计及比较研究：基于中国铜期货市场的检验 引证(12)

作者：付剑茹（华中科技大学）

学位名称：博士

出处：华中科技大学 2009

关键词：商品期货；最优套期保值比；目标函数；体制转换模型；卡尔曼滤波；贝叶斯统计；估计风险

[学位论文] 中国农产品期货市场功能与现货市场关系研究 引证(87)

作者：康敏（中国农业大学）

学位名称：博士

出处：中国农业大学 2005

关键词：农产品期货市场功能；现货市场；关系

[学位论文] 期转现与中国商品期货市场功能关系研究 引证(2)

作者：韩小龙（天津大学）

学位名称：博士

出处：天津大学 2009

关键词：期转现；生存分析；期货市场功能；流动性

[学位论文] 基于风险最小的期货套期保值优化模型研究 引证(6)

作者：杨中原（大连理工大学）

学位名称：博士

出处：大连理工大学 2009

关键词：期货；套期保值；套期保值比率；风险控制；决策模型

[学位论文] 基于条件风险价值的期货套期保值模型研究 引证(5)

作者：赵光军（大连理工大学）

学位名称：博士

出处：大连理工大学 2009

关键词：期货；期货套期保值；套期保值比率；条件风险价值

[学位论文] 中国商品期货市场流动性风险度量实证研究 引证(8)

作者：鲁小东（中南大学）

学位名称：博士

出处：中南大学 2009

关键词：中国商品期货市场；流动性特征；内、外生流动性风险度量；
流动性调整 VaR

[学位论文] 石油期货市场波动性与风险管理研究 引证(15)

作者：戴毓（南京航空航天大学）

学位名称：博士

出处：南京航空航天大学 2009

关键词：燃料油；期货；价格；波动性；风险

[学位论文] 股指期货在投资组合管理中的套期保值研究 引证(8)

作者：王欣（中国科学技术大学）

学位名称：博士

出处：中国科学技术大学 2009

关键词：股指期货；组合优化；分位数回归；决策树；Logistic 回归；套期保值效率；套期保值率；极大交迭离散小波变换；半方差；小波密度估计

[学位论文] 基于中国期货市场的加工企业套期保值策略研究 引证(20)

作者：高勇（西南交通大学）

学位名称：博士

出处：西南交通大学 2008

关键词：中国期货市场；套期保值绩效；协整；共同趋势模型

[学位论文] 金属期货价格关联规则挖掘

作者：郑涛（北京理工大学）

学位名称：博士

出处：北京理工大学 2009

关键词：金属期货；价格；时间序列；关联规则挖掘；征兆

[学位论文] 股指期货市场的风险测度研究

作者：龚志勇（华南理工大学）

学位名称：博士

出处：华南理工大学 2009

关键词：股指期货市场；风险管理；风险测度；实证分析

[学位论文] 关于建立中国石油期货市场的研究

作者：甘步红（中国社会科学院研究生院；中国社会科学院）

学位名称：博士

出处：中国社会科学院研究生院；中国社会科学院 2010

[学位论文] 期货套期保值优化决策模型及动态估计方法研究——以中国期货市场为例

作者：李丹（西安交通大学）

学位名称：博士

出处：西安交通大学 2009

关键词：套期保值；希尔伯特-黄转换；条件风险价值；极差 DCC 模型；指数平滑转移模型

[学位论文] 商品期货市场操纵行为预警与监控研究

作者：崔晓健（哈尔滨工业大学）

学位名称：博士

出处：哈尔滨工业大学 2009

关键词：期货；市场操纵；判别分析；预警系统；监管

[学位论文] 期货市场价格波动与中国货币政策关系研究

作者：梁晓娟（武汉大学）

学位名称：博士

出处：武汉大学 2009

关键词：货币政策；前瞻性；期货价格波动

[学位论文] 股指期货推出对股票市场的影响研究

作者：孟海亮（北京航空航天大学）

学位名称：博士

出处：北京航空航天大学 2009

关键词：股指期货；市场质量；理性预期；沪深 300 指数期货

[学位论文] 中国农产品期货市场风险及其影响因素分析

作者：杨雪（中国农业大学）

学位名称：博士

出处：中国农业大学 2009

关键词：农产品期货市场；现货市场；风险；影响因素

[学位论文] 中美农产品期货市场功能比较研究

作者：邵永同（中国农业大学）

学位名称：博士

出处：中国农业大学 2009

关键词：中美；农产品期货市场；功能；比较研究

[学位论文] 农产品期货市场与我国农业经营方式变革研究

作者：蔡胜勋（中国社会科学院研究生院；中国社会科学院）

学位名称：博士

出处：中国社会科学院研究生院；中国社会科学院 2010

[学位论文] 我国期货市场保证金模型及其应用研究

作者：侯隽（四川大学）

学位名称：博士

出处：四川大学 2010

关键词：期货市场；保证金；流动性指标；客观系统分析算法；风险控制

制制度

[学位论文] 国际金融危机下商品期货市场的传染效应研究

作者：张青（上海财经大学）

学位名称：博士

出处：上海财经大学 2010

[学位论文] 股指期货在机构投资者资产管理中的运用：理论与实证

作者：陈露（上海社会科学院）

学位名称：博士

出处：上海社会科学院 2009

关键词：股指期货；资产管理；投资组合保险策略；指数化投资；阿尔法策略

[学位论文] 期货市场操纵与侦察 引证(2)

作者：胡江华（华中科技大学）

学位名称：博士

出处：华中科技大学 2008

关键词：期货；市场操纵；微观结构；误差纠正模型

[学位论文] 我国钢材期货对钢铁生产企业经营业绩及市场价格的影响

研究

作者：刘丽平（北京科技大学）

学位名称：博士

出处：北京科技大学 2009

关键词：钢材期货；Garch 模型；市场价格；系统动力学

[学位论文] 中国期货市场的功能研究 引证(21)

作者：赵继光（吉林大学）

学位名称：博士

出处：吉林大学 2007

[学位论文] 期货市场流动性研究 引证(31)

作者：杨艳军（中南大学）

学位名称：博士

出处：中南大学 2006

关键词：期货市场；流动性；市场微观结构；期货合约；交易者特征

[学位论文] 股指期货法律问题研究 引证(8)

作者：吴明（中国政法大学）

学位名称：博士

出处：中国政法大学 2008

关键词：股指期货；风险管理；法律监管

[学位论文] 股指期货风险测算及监管研究 引证(22)

作者：曹忠忠（同济大学经济与管理学院）

学位名称：博士

出处：同济大学经济与管理学院 2007

关键词：股指期货；风险测算；金融自由化；法律监管

[学位论文] 石油期货市场风险问题研究 引证(8)

作者：贺晋兵（厦门大学）

学位名称：博士

出处：厦门大学 2008

关键词：石油期货；套期保值；投机交易；联合监管

[学位论文] 中国国债期货的运行制度研究 引证(18)

作者：张晓菊（同济大学）

学位名称：博士

出处：同济大学 2007

关键词：国债期货；交易制度；结算制度；交割制度；风险控制制度

[学位论文] 商品期货合约定价及影响因素研究 引证(4)

作者：马瑾（西南财经大学）

学位名称：博士

出处：西南财经大学 2008

关键词：商品期货合约价格；风险溢价；套期保值成本；交易者类型；
现货市场

[学位论文] 中国期货市场基本功能的实证研究 引证(47)

作者：王骏（华中科技大学）

学位名称：博士

出处：华中科技大学 2006

关键词：1 期货市场；基本功能；价格发现；套期保值；国际关联性

[学位论文] 农产品期货市场波动与效率研究 引证(16)

作者：高志杰（西北农林科技大学）

学位名称：博士

出处：西北农林科技大学 2007

关键词：农产品期货市场；价格波动；市场效率；价格发现；国际定价

[学位论文] 商品期货实物交割制度研究 引证(6)

作者：霍瑞戎（东北财经大学）

学位名称：博士

出处：东北财经大学 2009

关键词：期货交割；期货市场功能；交割制度；建议

[学位论文] 期货交易风险管理决策模型研究 引证(7)

作者：周颖（大连理工大学）

学位名称：博士

出处：大连理工大学 2008

关键词：期货风险价值；期货保证金；套期保值

[学位论文] 我国生猪现货及期货市场研究 引证(36)

作者：陶一山（中南大学）

学位名称：博士

出处：中南大学 2006

关键词：生猪市场；生猪价格；生猪期货市场；现金交割制度；价格波

动

[学位论文] 中国期货市场风险监管研究 引证(4)

作者：田洪（华中科技大学）

学位名称：博士

出处：华中科技大学 2008

关键词：期货市场；风险监管；风险评级；监管体系；监管创新；功能

监管

[学位论文] 股指期货交易中操纵行为识别方法研究 引证(9)

作者：佟伟民（哈尔滨工业大学）

学位名称：博士

出处：哈尔滨工业大学 2008

关键词：股指期货；行为识别；支持向量机；小波分析；多分类融合器

[学位论文] 沪深 300 股指期货合约设计研究 引证(3)

作者：王莹（同济大学）

学位名称：博士

出处：同济大学 2008

关键词：股指期货；合约乘数；最后结算价格；每日结算价格；保证金；

最小价格变动单位；价格限制

[学位论文] 我国期货经纪业的结构、行为与绩效研究 引证(2)

作者：冯凯（厦门大学）

学位名称：博士

出处：厦门大学 2008

关键词：期货经纪业；期货公司；结构、行为与绩效

[学位论文] 中国金融衍生品研究与中国期货市场实践 引证(39)

作者：王石（吉林大学）

学位名称：博士

出处：吉林大学 2006

关键词：金融衍生品；金融创新；股指期货；风险监管

[学位论文] 新兴市场股票指数期货的定价效率与价格发现研究 引证

(15)

作者：李帅（天津大学）

学位名称：博士

出处：天津大学 2007

关键词：股票指数期货；定价效率；价格发现；不完美市场；非线性动力系统

[学位论文] 境内推出股指期货关键技术与制度问题研究 引证(8)

作者：汪琛德（湖南大学）

学位名称：博士

出处：湖南大学 2008

关键词：境内股指期货；标的股指选择；合约设计；风险控制制度

[学位论文] 汇率波动下石油期货价格建模及随机最优投资组合的研究 引证(4)

作者：闫伟（中国石油大学）

学位名称：博士

出处：中国石油大学 2008

关键词：石油期货；汇率波动；多阶段半方差；随机最优控制；随机哈密顿-雅克比-贝尔曼方程；投资组合；数值方法

[学位论文] 股指期货的应用及交易策略研究

作者：徐凌（四川大学）

学位名称：博士

出处：四川大学 2009

[学位论文] 股指期货市场微观结构模型研究

作者：刘显昌（中山大学）

学位名称：博士

出处：中山大学 2009

[学位论文] 中国期货历史及经济学分析

作者：常远（中国社会科学院研究生院；中国社会科学院）

学位名称：博士

出处：中国社会科学院研究生院；中国社会科学院 2009

[学位论文] 股指期货期现套利研究

作者：张辉（同济大学经济与管理学院）

学位名称：博士

出处：同济大学经济与管理学院 2008

关键词：股指期货市场；期现套利；套利机会；资本市场；交易成本；套利理论；期货套利；定价模型；持有成本模型；价格；实证分析；香港恒生指数期货；门限协整；期货定价；风险；策略；协整模型；收益；...

[学位论文] 中国期货业政府监管研究

作者：赵玉玲（中央财经大学）

学位名称：博士

出处：中央财经大学 2008

关键词：期货；政府监管；监管机构

[学位论文] 期货市场对实体经济的影响研究

作者：李玮（北京师范大学）

学位名称：博士

出处：北京师范大学 2008

关键词：期货市场；套期保值；价格发现；投机套利

[学位论文] 中国期货交易所市场的竞争与监管

作者：李雪静（上海财经大学）

学位名称：博士

出处：上海财经大学 2008

关键词：金融市；期权；期货市场；市场监管

[学位论文] 股指期货套利交易与风险控制研究

作者：张毅（武汉大学）

学位名称：博士

出处：武汉大学 2008

关键词：股指期货；套利；门限模型；交易策略；风险控制

[学位论文] 期货市场与现货市场联动机制研究

作者：杨扬（上海财经大学）

学位名称：博士

出处：上海财经大学 2008

关键词：国际贸易；期货市场；现货市场；市场协调

[学位论文] 我国金属期货价格指数编制研究

作者：李宇海（上海财经大学）

学位名称：博士

出处：上海财经大学 2008

关键词：金属期货；期货价格指数；期货市场；金属期货市场；投资职

能

[学位论文] 石油期货市场风险问题研究——基于燃料油期货市场的统计分析

作者：贺晋兵（厦门大学图书馆）

学位名称：博士

出处：厦门大学图书馆 2008

关键词：石油期货；套期保值；投机交易；联合监管

[学位论文] 期货市场对实体经济的影响研究：以铜期货市场为例

作者：李（韦华）（北京师范大学）

学位名称：博士

出处：北京师范大学 2008

关键词：期货市场；实体经济；市场组织；组织形态；期货交易；金融

体系

[学位论文] 国际石油期货价格预测及风险度量研究

作者：温渤（中国科学院数学与系统科学研究院）

学位名称：博士

出处：中国科学院数学与系统科学研究院 2008

关键词：石油期货；价格预测；风险度量；市场风险；流动性风险

[学位论文] 资源性商品期货市场价格形成机制和中国对策研究

作者：诸葛栋（浙江大学经济学院）

学位名称：博士

出处：浙江大学经济学院 2008

关键词：资源性商品；期货市场价格；形成机制

[学位论文] 两篇探讨委托单驱动之期货市场下单策略与市场行为之研究

作者：吴如萍（国立高雄第一科技大学）

学位名称：博士

出处：国立高雄第一科技大学 2008

关键词：限价单；市价单；下单策略；期货市场；逆选择成本；市场深度

[学位论文] 基于小波分解的股指期货对现货波动影响研究

作者：李海生（华南理工大学）

学位名称：博士

出处：华南理工大学 2008

关键词：小波分解；股指期货；现货市场；市场波动性；指数期货；波动影响；综合指数；期货交易；研究方法；股票现货；风险控制；仿真；小波函数；提高；实证研究；实证结果；期货合约；金融体制改革；水...

[学位论文] 我国期货投资基金培育及监管

作者：张志勇（上海交通大学）

学位名称：博士后

出处：上海交通大学 2010

关键词：期货市场；期货投资基金；基金监管；基金收益率；运营管理；清算退出制度

[学位论文] 全球期货交易所竞争战略分析

作者：苏依依（上海交通大学）

学位名称：博士后

出处：上海交通大学 2010

制

关键词：机构投资者；期货交易所；竞争战略；绩效驱动模型；运行机

[学位论文] 人民币对外币期货市场及其风险管理功能研究

作者：熊志刚（武汉大学）

学位名称：博士

出处：武汉大学 2008

关键词：外汇风险；外汇期货；价格发现；风险管理；定价权

[学位论文] 期货监管立法研究 引证(4)

作者：陈少云（中国政法大学）

学位名称：博士

出处：中国政法大学 2007

关键词：期货监管；立法；有效监管；放松管制

[学位论文] 期货投资基金法律问题研究

作者：雷晓冰（上海交通大学；上海期货交易所）

学位名称：博士后

出处：上海交通大学；上海期货交易所 2009

关键词：期货投资基金；商品基金经理；商品交易顾问；合格投资者

[学位论文] 我国钢材指数期货设计研究

作者：陈晔（上海交通大学；上海期货交易所）

学位名称：博士后

出处：上海交通大学；上海期货交易所 2009

关键词：钢材；长材指数；期货；设计

[学位论文] 中国期货市场金融衍生品创新与风险管理问题研究

作者：部慧（中国科学院研究生院）

学位名称：博士

出处：中国科学院研究生院 2009

关键词：期货市场

[学位论文] 中国国债期货试点期间的市场效率研究：基于上海证券所数据

作者：陈克禄（上海财经大学）

学位名称：博士

出处：上海财经大学 2009

[学位论文] 期货市场流动性与流动性风险研究

作者：李泽海（上海交通大学；上海期货交易所）

学位名称：博士后

出处：上海交通大学；上海期货交易所 2009

关键词：期货市场；市场流动性；流动性风险；交易风险；风险度量

[学位论文] 我国期货市场效率与风险研究 引证(14)

作者：张小艳（华中科技大学）

学位名称：博士

出处：华中科技大学 2006

关键词：有效市场假设；资本资产定价模型；期货市场；期货市场风险

[学位论文] 中国期货市场交易者互动研究 引证(8)

作者：蒋舒（上海交通大学）

学位名称：博士

出处：上海交通大学 2007

关键词：期货市场；交易者互动；跨市套利；行为金融；市场操纵；期货市场有效性；涨跌幅限制有效性

[学位论文] 中国期货市场品种创新研究 引证(11)

作者：张建刚（天津大学）

学位名称：博士

出处：天津大学 2006

关键词：金融创新；期货市场；流动性；套期保值；上市时机选择

[学位论文] 国际铜期货信息传递与资产定价 引证(1)

作者：郑葵方（北京航空航天大学）

学位名称：博士

出处：北京航空航天大学 2007

关键词：资产定价；信息传递；铜期货；国际市场

[学位论文] 我国期货市场结算风险管理研究 引证(9)

作者：徐毅（中国科学技术大学）

学位名称：博士

出处：中国科学技术大学 2007

关键词：期货结算；结算风险；中央对手方；保证金；分级结算会员制；
结算担保金

[学位论文] 农产品期货价格形成机理研究 引证(19)

作者：吕东辉（吉林大学）

学位名称：博士

出处：吉林大学 2006

关键词：农产品期货市场；期货价格；形成与变化；行为金融学；资产
定价模式；认知与行为偏差

[学位论文] 论金融期货风险的法律控制 引证(4)

作者：温观音（中国政法大学）

学位名称：博士

出处：中国政法大学 2007

关键词：金融期货；系统性风险；法律控制；监管；市场完整性

[学位论文] 商品期货价差套利投资决策理论与应用研究 引证(27)

作者：唐衍伟（同济大学）

学位名称：博士

出处：同济大学 2006

关键词：期货价差套利；定价；便利收益；最优价差套利头寸；风险管理；交易策略

[学位论文] 中国金属期货市场套利交易与风险控制研究 引证(14)

作者：景楠（暨南大学）

学位名称：博士

出处：暨南大学 2006

关键词：金属期货；套利；套利投资组合；VAR；风险控制

[学位论文] 股指期货交易行为与现金结算价确定研究 引证(4)

作者：郑尊信（上海交通大学）

学位名称：博士

出处：上海交通大学 2007

关键词：股指期货；交易行为；现金结算价；机制设计

[学位论文] 中国期货市场波动性与价格操纵行为研究 引证(33)

作者：刘庆富（东南大学）

学位名称：博士

出处：东南大学 2005

关键词：期货市场；现货市场；波动性；价格操纵；有效性

[学位论文] 基于异质交易者的期货市场价格动态研究 引证(3)

作者：李钊（哈尔滨工业大学）

学位名称：博士

出处：哈尔滨工业大学 2007

关键词：期货价格；异质交易者；计算金融学；基于 Agent 仿真

[学位论文] 中国期货市场微观结构理论与实证研究 引证(10)

作者：杜军（华中科技大学）

学位名称：博士

出处：华中科技大学 2006

关键词：期货市场；市场微观结构；价格形成机制；市场流动性；市场波动性；市场透明度

[学位论文] 我国国债期货的发展

作者：卢晟（中国社会科学院(北京)；中国社会科学院）

学位名称：博士后

出处：中国社会科学院(北京)；中国社会科学院 2009

[学位论文] 基于 JMR 过程的商品期货期权定价模型及保证金计算模型研究

作者：纪婧（上海交通大学）

学位名称：博士后

出处：上海交通大学 2010

关键词：商品期货期权；期权定价；均值回复；风险度量；保证金计算模型；MonteCarlo 模拟

[学位论文] 股指期货在基金公司投资组合管理中的应用研究

作者：韩广哲（中国社会科学院金融研究所(北京)；中国社会科学院；中国社会科学院金融研究所）

学位名称：博士后

出处：中国社会科学院金融研究所(北京)；中国社会科学院；中国社会科学院金融研究所 2010

[学位论文] 我国天然胶期货市场有效性实证分析及对策建议 引证(10)

作者：龚国光（同济大学）

学位名称：博士

出处：同济大学 2006

关键词：天然胶期货市场；有效市场假说；协整检验；自回归条件异方差；随机步游检验

[学位论文] 我国石油期货市场研究

作者：李辉（上海社会科学院）

学位名称：博士

出处：上海社会科学院 2007

关键词：石油市场；期货交易；定价；风险管理

[学位论文] 期货公司风险管理问题研究

作者：黄小龙（同济大学）

学位名称：博士

出处：同济大学 2008

关键词：期货公司；风险管理；聚类分析；法人治理结构

[学位论文] 国内股指期货套利和避险实证研究

作者：胡浩（中国人民大学）

学位名称：博士

出处：中国人民大学 2007

关键词：股票指数期货；套利；风险分析

[学位论文] 农产品期货市场福利效应分析

作者：（厦门大学）

学位名称：博士

出处：厦门大学 2007

关键词：future; market; welfare; effect; agricultural; products

[学位论文] 期货交易所联网交易研究

作者：杨丽琳（上海财经大学）

学位名称：博士

出处：上海财经大学 2007

关键词：期货交易所；联网交易；网络外部性；市场微观结构

[学位论文] 股指期货风险测算及监管研究

作者：（同济大学）

学位名称：博士

出处：同济大学 2007

关键词：Stock; index; futures; the; risk; measure; financial; liberalization;
legal; supervision; empirical; ...

[学位论文] 中国煤炭市场预测及期货交易设计

作者：邵汝军（河海大学）

学位名称：博士

出处：河海大学 2007

关键词：煤炭市场；市场预测；期货交易；中国

[学位论文] 中国期货市场微观结构与期现货间关系研究

作者：刘向丽（中国科学院研究生院(本部)；中国科学院研究生院）

学位名称：博士

出处：中国科学院研究生院(本部)；中国科学院研究生院 2008

关键词：期货市场

[学位论文] 两岸期货交易所竞争力之比较研究

作者：李惠华（上海财经大学）

学位名称：博士

出处：上海财经大学 2007

关键词：期货交易；期货市场；交易所

[学位论文] 利用农产品期货市场服务黑龙江省新农村建设

作者：刘畅（东北农业大学）

学位名称：博士

出处：东北农业大学 2007

关键词：农产品期货市场；黑龙江省；新农村建设

[学位论文] 石油期货价格行为与最优风险管理策略研究

作者：苟三权（中国矿业大学）

学位名称：博士

出处：中国矿业大学 2007

关键词：石油价格；期货市场；风险管理

[学位论文] 投资者行为对石油期货市场的影响研究

作者：赵茜（中国人民大学）

学位名称：博士

出处：中国人民大学 2007

关键词：石油市场；期货交易；投资行为；投机

[学位论文] 中国棉花期货市场运行质量分析与对策

作者：李慧茹（中国矿业大学）

学位名称：博士

出处：中国矿业大学 2007

关键词：棉花；期货市场；市场运行；市场分析

[学位论文] 期货市场相关性分析及其度量方法研究

作者：武杨（北京理工大学）

学位名称：博士

出处：北京理工大学 2007

关键词：期货市场；相关性度量；Granger 因果；R/S 分析；小波变换；

Copula 相关

[学位论文] 离散时间不完全市场下基于鞅方法的期货定价研究

作者：张力健（北京航空航天大学）

学位名称：博士

出处：北京航空航天大学 2007

关键词：离散时间不完全市场；未定权益定价；期货定价；最优等价鞅测度；最优增长组合；极小鞅测度；实证研究

[学位论文] 中国农产品期货基差动态调整过程及策略分析

作者：易蓉（中国科学院研究生院(本部)；中国科学院研究生院）

学位名称：博士

出处：中国科学院研究生院(本部)；中国科学院研究生院 2008

关键词：期货市场

[学位论文] 石油期货价格预测研究 引证(4)

作者：祝金荣（北京理工大学）

学位名称：博士

出处：北京理工大学 2006

关键词：石油期货价格；预测；支持向量回归；混合预测

[学位论文] 股指期货的国际比较研究 引证(69)

作者：徐旭初（复旦大学）

学位名称：博士

出处：复旦大学 2003

关键词：金融市场；期货；股票指数期货

[学位论文] 中国期货市场效率实证研究 引证(31)

作者：齐明亮（华中科技大学）

学位名称：博士

出处：华中科技大学 2004

关键词：期货市场；市场效率；套期保值；价格发现；市场微观结构；
市场透明度；市场流动性

[学位论文] 我国期货市场功能有效性研究 引证(12)

作者：祁国中（华东师范大学）

学位名称：博士

出处：华东师范大学 2005

关键词：期货市场；功能有效性；套期保值；价格发现；制度创新

[学位论文] 股指期货价格形成机制研究 引证(13)

作者：杨朝峰（同济大学）

学位名称：博士

出处：同济大学 2005

关键词：股指期货；价格形成机制；价格均衡机制；价格稳定机制

[学位论文] 农产品期货市场福利效应分析 引证(3)

作者：孙坚强（厦门大学）

学位名称：博士

出处：厦门大学 2006

关键词：期货市场；福利效应；农产品

[学位论文] 期货市场风险及其监管研究 引证(20)

商

作者：佟德庆（西北大学）

学位名称：博士

出处：西北大学 2005

关键词：期货市场；期货功能；风险度量；风险监管；市场构成；做市

[学位论文] 电力市场期货交易中的模式、电价及风险研究 引证(8)

作者：廉小虎（华中科技大学）

学位名称：博士

出处：华中科技大学 2006

关键词：电力市场；期货交易；价格；灰色预测；贝叶斯预测；风险

[学位论文] 玉米期货市场对新疆玉米产业保障作用研究 引证(8)

作者：王军（新疆农业大学）

学位名称：博士

出处：新疆农业大学 2006

关键词：玉米；期货市场；保障作用

[学位论文] 防止现货市场与商品期货市场间操纵之研究 引证(1)

作者：庞作祥（同济大学）

学位名称：博士

出处：同济大学 2006

关键词：期货市场操纵；操纵诊断；操纵成本；操纵收益；期货市场流

动性

[学位论文] 我国期货价格行为与市场稳定机制研究 引证(13)

作者：楼迎军（浙江大学）

学位名称：博士

出处：浙江大学 2005

关键词：农产品期货；极值理论；GARCH 模型；波动持续性；长记忆效应；预警机制

[学位论文] 期货市场的风险控制

作者：高峰（清华大学）

学位名称：博士

出处：清华大学 2006

关键词：期货市场；风险管理；保证金

[学位论文] 股指期货投资策略

作者：金登贵（上海交通大学）

学位名称：博士后

出处：上海交通大学 2007

关键词：股指期货；投资策略；套期保值；市场波动

[学位论文] 我国金融期货市场发展研究

作者：周波（北京师范大学）

学位名称：博士

出处：北京师范大学 2006

关键词：金融期货市场；交易结算场所；交易机制；投资主体；风险管理

理

[学位论文] 中国期货市场监管与投资者保护

作者：毛小云（上海财经大学）

学位名称：博士

出处：上海财经大学 2006

关键词：期货市场；期货交易；投资者；金融监管

[学位论文] 期货市场操纵的诊断及其监管研究

作者：马卫锋（同济大学）

学位名称：博士

出处：同济大学 2006

关键词：期货市场；市场操纵；风险案例

[学位论文] 剩余价值理论视野下的期货市场：兼论发展我国期货市场的理论与实践

作者：崔迎秋（华中师范大学）

学位名称：博士

出处：华中师范大学 2006

关键词：期货市场；期货投资者；剩余价值理论；剩余价值的让渡

[学位论文] 期货交易特征分析的时序数据处理方法与实证研究

作者：吴载斌（北京航空航天大学）

学位名称：博士

出处：北京航空航天大学 2006

关键词：期货交易特征；时序数据处理；时序相似性；距到期日效应；交割月效应；交易集中度；特异合约；国际比较

[学位论文] 期货市场的风险控制：保证金设置的若干问题研究

作者：高峰（清华大学）

学位名称：博士

出处：清华大学 2006

关键词：风险管理；期货保证金；波动率

[学位论文] 基于特性分析的石油期货定价预测与对策研究

作者：（华中科技大学）

学位名称：博士

出处：华中科技大学 2006

关键词: Petroleum; futures; Influencing; factor; Price; discovery; Volatility;
Correlativity; Forecast

[学位论文] 中国商品期货期权市场微观结构研究

作者: 王学勤 (中国人民大学)

学位名称: 博士

出处: 中国人民大学 2006

关键词: 商品期货; 期货市场; 期权交易; 期权定价; 做市商

[学位论文] 上海期货交易所交易机制分析及产品创新研究

作者: 肖辉 (复旦大学)

学位名称: 博士

出处: 复旦大学 2006

关键词: 上海期货交易所; 伦敦金属交易所; 价格发现; 期权; 做市商

[学位论文] 股指期货异地上市对本土市场的影响

作者: 余书炜 (复旦大学)

学位名称: 博士

出处: 复旦大学 2006

关键词: 股指期货; 异地上市; 本土市场; 股指期权; 股票市场

[学位论文] 金融发展理论框架下的中国期货市场研究

作者: 杨继 (复旦大学)

学位名称: 博士

出处: 复旦大学 2006

关键词: 期货市场; 金融期货; 储蓄率; 资本产出率

[学位论文] 期货市场套期保值若干问题的研究

作者: 刘庆伟 (中国科学院数学与系统科学研究院)

学位名称：博士

出处：中国科学院数学与系统科学研究院 2006

关键词：套期保值；委托代理；交割选择权；交割风险；应急管理；非对称 GARCH

[学位论文] 股价指数期货报酬尾部行为 与保证金水准之设定

作者：高子荃（国立高雄第一科技大学）

学位名称：博士

出处：国立高雄第一科技大学 2006

关键词：结构性转变；保证金设定；尾部指数；极值分析

[学位论文] 我国利率期货发展的制度经济学分析及相关制度设计

作者：毕鹏（西安交通大学）

学位名称：博士

出处：西安交通大学 2006

关键词：利率期货；制度分析；制度设计

[学位论文] 期权定价研究——考虑上海期货交易所交易规则的期权定价

作者：谷艳玲（复旦大学）

学位名称：博士

出处：复旦大学 2006

关键词：期权定价；交易保证金；做市商；风险控制；期货交易；交易规则

[学位论文] 我国期货市场风险控制预警系统研究

作者：（上海交通大学）

学位名称：博士后

出处：上海交通大学 2007

关键词：期货市场；风险控制；结算频率；预警指标体系

[学位论文] 利率期货对完善我国利率期限结构的作用研究

作者：卢庆杰（上海交通大学）

学位名称：博士后

出处：上海交通大学 2007

关键词：利率期限结构；市场化进程；国债期货市场；预示效应

[学位论文] 中国国债期货交易研究 引证(13)

作者：何迎新（西南财经大学）

学位名称：博士

出处：西南财经大学 2004

关键词：国债期货交易；启示；失败的原因；必要性；可行性；构想

[学位论文] 中国期货市场的风险控制研究 引证(25)

作者：虞立戎（复旦大学）

学位名称：博士

出处：复旦大学 2004

关键词：期货市场；中国；风险控制

[学位论文] 中国期货市场发展的制度分析 引证(3)

作者：欧阳日辉（中国社会科学院）

学位名称：博士

出处：中国社会科学院 2005

关键词：期货市场；期货交易；市场效率

[学位论文] 股票指数期货交易策略及风险管理研究 引证(31)

作者：王宝森（天津大学）

学位名称：博士

出处：天津大学 2003

关键词：股票指数期货；套利；套期保值；投机；风险管理

[学位论文] 中国农产品期货市场效率问题的研究 引证(17)

作者：彭浩（西南财经大学）

学位名称：博士

出处：西南财经大学 2004

关键词：有效市场假说；期货市场；协整；自回归条件异方差；信息熵

[学位论文] 我国粮食流通体制改革中的期货市场利用问题研究 引证

(12)

作者：王健（浙江大学）

学位名称：博士

出处：浙江大学 2004

关键词：粮食流通体制；改革；期货市场；利用

[学位论文] 多粒度语言评价信息的群决策问题研究与股指期货相关问题研究 引证(1)

作者：王欣荣（上海交通大学）

学位名称：博士

出处：上海交通大学 2005

关键词：群决策理论；多粒度语言评价信息；股指期货；套期保值；风险管理

[学位论文] 中国期货市场投机泡沫理论与实证分析

作者：陈锐刚（中国科学院研究生院(本部)管理学院；中国科学院研究生院）

学位名称：博士

出处：中国科学院研究生院(本部)管理学院；中国科学院研究生院 2006

关键词：期货市场

[学位论文] 期货市场功能实现的研究

作者：刘洋（北京大学）

学位名称：博士

出处：北京大学 2005

关键词：期货市场；价格；套期保值

[学位论文] 中国期货市场可持续发展研究

作者：季文茹（中国人民大学）

学位名称：博士

出处：中国人民大学 2005

关键词：期货市场；可持续发展；期货交易；风险管理

[学位论文] 期货市场价格功能的理论分析

作者：邢莹莹（北京大学）

学位名称：博士

出处：北京大学 2005

关键词：期货市场；期货价格；期货交易

[学位论文] 期货市场风险管理若干问题探讨

作者：韩高峰（复旦大学）

学位名称：博士

出处：复旦大学 2005

关键词：极值理论；期货市场；期货交易；风险管理；人民币汇率

[学位论文] 期货交易所的公司化改制

作者：王凤海（东北财经大学）

学位名称：博士

出处：东北财经大学 2005

关键词：证券交易所；期货交易；公司化；体制改革

[学位论文] 国际贸易价格风险控制：中国期货市场国际化问题的探索

作者：刘晓雪（中国人民大学）

学位名称：博士

出处：中国人民大学商学院 2006

关键词：价格风险控制；期货市场；国际化

[学位论文] 期货市场政府与交易所监管权分配问题研究

作者：孙秋鹏（中国社会科学院）

学位名称：博士

出处：中国社会科学院 2005

关键词：期货市场；监管体制；证券交易所

[学位论文] 我国期货市场互动式投资策略研究

作者：刘慧宏（中国科学技术大学）

学位名称：博士

出处：中国科学技术大学 2005

关键词：期货；合作博弈；投资策略

[学位论文] 上海铜期货交易保证金设置研究

作者：鲍建平（上海交通大学）

学位名称：博士

出处：上海交通大学 2005

关键词：铜；期货交易；保证金；波动性；流动性；期货市场

[学位论文] 电力期货市场理论与运行 引证(1)

作者：倪迎春（中国人民大学）
学位名称：博士
出处：中国人民大学 2004
关键词：电力；期货市场；风险管理

[学位论文] 农产品期货市场经济功能分析 引证(29)

作者：甘正在（中国社会科学院研究生院）
学位名称：博士
出处：中国社会科学院研究生院 2003
关键词：期货市场；农产品期货市场

[学位论文] 中国期货公司监管制度研究 引证(10)

作者：曹胜（中国社会科学院研究生院）
学位名称：博士
出处：中国社会科学院研究生院 2003
关键词：期货公司；监管；中国

[学位论文] 股指期货在我国的应用研究 引证(13)

作者：臧玉卫（天津大学）
学位名称：博士
出处：天津大学 2003
关键词：股指期货；数据挖掘；神经网络；贝叶斯网络；定价；风险管

理

[学位论文] 股指期货市场研究 引证(11)

作者：李慕春（东北财经大学）
学位名称：博士
出处：东北财经大学 2001
关键词：股指期货；路径选择；数量经济；期货市场

[学位论文] 期货交易法律关系研究 引证(10)

作者：文海兴（中国政法大学）

学位名称：博士

出处：中国政法大学 1995

关键词：期货交易法

[学位论文] 中国国债期货价格与交割制度研究

作者：黄河（武汉大学）

学位名称：博士

出处：武汉大学 2004

关键词：国债期货；交割制度；空方选择权

[学位论文] 铜期货期权品种开发与风险管理

作者：奚炜（复旦大学）

学位名称：博士

出处：复旦大学 2004

关键词：铜期货期权；并行交易；合约设计；期权定价；风险管理

[学位论文] 中国期货市场规范化发展研究 引证(13)

作者：张书帮（西南财经大学）

学位名称：博士

出处：西南财经大学 1999

关键词：期货；市场规范

[学位论文] 基于现货市场与期货市场价格相对有效的定价研究

作者：肖辉（上海交通大学）

学位名称：博士

出处：上海交通大学 2004

关键词：市场微观结构；现货市场；期货市场；股票指数；价格发现；

流动性；定价模型

[学位论文] 中国商品期货市场的流动性与波动性研究

作者：周志明（上海交通大学）

学位名称：博士

出处：上海交通大学 2004

关键词：商品期货；金融市场；均衡价格；流动性；波动性

[学位论文] 我国推出股指期货的理论研究及模式设计

作者：（华中科技大学）

学位名称：博士

出处：华中科技大学 2004

关键词：Stock； Price； Index； Futures(SPIF)； Arbitrage； &； Hedging；

Model； Design； Risk； Control

[学位论文] 股份指数期货对现货市场影响研究

作者：梁万泉（南开大学）

学位名称：博士

出处：南开大学 2004

[学位论文] 我国股票指数期货市场运作模式研究 引证(12)

作者：彭俊衡（上海社会科学院）

学位名称：博士

出处：上海社会科学院 2002

关键词：期货市场；资本市场；股指期货

[学位论文] 中国股指期货交易风险控制几个关键问题研究

作者：刘文财（复旦大学）

学位名称：博士

出处：复旦大学 2004

关键词：保证金；持仓限制；涨跌停板；股指期货；风险控制

[学位论文] 利率期货与中国债券市场发展——若干问题研究

作者：杨建明（复旦大学）

学位名称：博士

出处：复旦大学 2004

关键词：利率期货；国债市场；价格发现；利率风险

[学位论文] 我国农产品期货市场发展问题研究 引证(12)

作者：曲立峰（东北财经大学）

学位名称：博士

出处：东北财经大学 2001

关键词：农产品；期货市场

[学位论文] 基于期货理论的电力交易模式与方法研究

作者：祁达才（清华大学）

学位名称：博士

出处：清华大学 2004

关键词：电力工业；市场交易；电力市场；期货；拍卖；套期保值

[学位论文] 我国天然橡胶期货风险控制参数设定的实证研究

作者：侯晓鸿（复旦大学）

学位名称：博士

出处：复旦大学 2004

关键词：持仓限制；保证金水平；涨跌停板；计量模型；天胶期货

[学位论文] 国债期货价格波动性与交易机制研究

作者：王乃生（复旦大学）

学位名称：博士

出处：复旦大学 2004

关键词：交易机制；波动性；涨跌停板；保证金

[学位论文] 我国农产品期货市场发展的理论和战略性研究 引证(10)

作者：常清（中国社会科学院研究生院）

学位名称：博士

出处：中国社会科学院研究生院 2001

关键词：期货市场；战略性研究；我国农产品；中国农产品；期货价格；现货价格；价格信息；经济发展；农产品期货市场；现货市场

[学位论文] 股指期货与金融安全研究 引证(5)

作者：王沛英（厦门大学）

学位名称：博士

出处：厦门大学 2003

关键词：金融安全；股指期货；波动

[学位论文] 期货市场创新理论与实证研究 引证(1)

作者：朱丽红（东北财经大学）

学位名称：博士

出处：东北财经大学 2003

关键词：期货市场

[学位论文] 我国期货市场价格波动特征及运行效率研究 引证(1)

作者：华仁海（东南大学）

学位名称：博士

出处：东南大学 2003

关键词：期货市场；价格波动；运行效率；协整检验；误差修正模型；

GARCH 模型

[学位论文] 金融期权、期货与基础市场间关系的研究 引证(1)

作者：吕晓峰（复旦大学）

学位名称：博士

出处：复旦大学 2003

关键词：金融期权；期货；金融市场；关系；效率

[学位论文] 中国期货市场研究 引证(1)

作者：曾庆民（暨南大学）

学位名称：博士

出处：暨南大学 1998

关键词：中国；期货市场

[学位论文] 中国期货市场的效率研究

作者：党剑（南开大学）

学位名称：博士

出处：南开大学 2003

关键词：期货交易；资本市场；效率

[学位论文] 金融期货法律制度研究 引证(1)

作者：罗扬眉（中国社会科学院）

学位名称：博士

出处：中国社会科学院 1999

关键词：金融期货法律制度；金融监管

[学位论文] 期货市场风险控制论 引证(7)

作者：姬广坡（武汉大学）

学位名称：博士

出处：武汉大学

关键词：期货市场；风险；风险控制

[学位论文] 中国期货市场风险研究 引证(8)

作者：褚珏海（上海社会科学院）

学位名称：博士

出处：上海社会科学院 2001

关键词：中国期货市场；金融风险；期货市场

[学位论文] 期货市场风险管理的法律机制研究 引证(9)

作者：李明良（中国人民大学）

学位名称：博士

出处：中国人民大学 1998

关键词：期货市场；风险管理；民法

[学位论文] 论七十年代以来期货市场的创新 引证(1)

作者：江明华（北京大学）

学位名称：博士

出处：北京大学 1997

关键词：期货；市场；交易工具

[学位论文] 论发展中的中国期货市场 引证(3)

作者：李强（东北财经大学）

学位名称：博士

出处：东北财经大学 1998

关键词：中国期货市场；期货市场

[学位论文] 期货市场成长论-中国现阶段期货市场的理论思考 引证(1)

作者：马源平（西安交通大学）

学位名称：博士

出处：西安交通大学 1998

关键词：期货；市场；成长；中国

[学位论文] 期货价格形成机制的系统分析与中国期货市场发展战略研究 引证(1)

作者：黄长征（西安交通大学）

学位名称：博士

出处：西安交通大学 1996

关键词：期货；价格形成；系统分析；战略研究

[学位论文] 股价指数期货理论与实践的若干问题研究 引证(1)

作者：张学东（西安交通大学）

学位名称：博士

出处：西安交通大学 2002

关键词：期货市场；股票市场；股价指数期货；金融工程

[学位论文] 中国股票指数期货：标的指数与合约设计 引证(2)

作者：章飙（厦门大学）

学位名称：博士

出处：厦门大学 2001

关键词：中国；股票指数期货；标的指数

[学位论文] 非有效不完全市场条件下股票指数期货交易策略的研究

作者：苏圻涵（同济大学经济与管理学院）

学位名称：博士

出处：同济大学经济与管理学院 2003

关键词：股票指数；股票指数期货；套利；套期保值；投机；基差；未平仓合约

[学位论文] 期货市场理论与实证

作者：药建英（中国社会科学院）

学位名称：博士

出处：中国社会科学院

[学位论文] 期货交易的创新

作者：王新政（武汉大学）

学位名称：博士

出处：武汉大学

关键词：创新；期货市场；电子交易；知识经济

[学位论文] 论中国期货市场·下册

作者：田源（武汉大学）

学位名称：博士

出处：武汉大学

关键词：期货市场

[学位论文] 金融期货法律问题研究

作者：于洋（中国政法大学）

学位名称：博士

出处：中国政法大学 2002

关键词：金融法；期货；金融期货

[学位论文] 国际金融期货市场研究

作者：周功华（中国社会科学院）

学位名称：博士

出处：中国社会科学院

[学位论文] 股票和期货价格的比较分析

作者：张晋生（中国人民银行金融研究所）

学位名称：博士

出处：中国人民银行金融研究所 1995

关键词：股票定价；期货价格

[学位论文] 中国期货市场初论

作者：张承惠（中国社会科学院）

学位名称：博士

出处：中国社会科学院

[学位论文] 期货交易法律制度研究

作者：吴峥（中国社会科学院）

学位名称：博士

出处：中国社会科学院 1995

关键词：期货交易；管理；法律

[学位论文] 期货交易法律问题研究

作者：杨永清（中国人民大学）

学位名称：博士

出处：中国人民大学

关键词：期货交易；法律问题；研究

[学位论文] 股指期货投资策略研究

作者：袁象（上海交通大学）

学位名称：博士

出处：上海交通大学 2002

关键词：股指期货；投资策略；保值比率；保值有效性；基尼均值系数

[学位论文] 中国期货市场发展道路

作者：陈志军（武汉大学）

学位名称：博士

出处：武汉大学

关键词：期货市场；发展；管理；创新

[学位论文] 外汇现货与期货市场的价格发现能力

作者：陈佑伦（暨南大学）

学位名称：博士

出处：暨南大学

关键词：价格发现；讯息份额；电子中介服务系统；委托单流量

[学位论文] 中国期货市场发展与创新研究

作者：朱江鸿（复旦大学）

学位名称：博士

出处：复旦大学 2002

关键词：期货市场

[学位论文] 金融期货和期权市场监管制度研究

作者：胡孝红（武汉大学）

学位名称：博士

出处：武汉大学 2000

关键词：监管制度；交易所自律监管；行业自律监管；国家监管

[学位论文] 我国期货交易及风险管理研究

作者：陈中放（浙江大学）

学位名称：博士

出处：浙江大学 1998

关键词：风险管理问题；风险成因；经济数学；期货交易；风险

[学位论文] 中国商品期货市场风险控制研究

作者：侯晓鸿（中南工业大学）

学位名称：博士

出处：中南工业大学 1999

关键词：中国商品；期货市场；风险控制；风险预警

[学位论文] 基于特性分析的石油期货定价预测与对策研究

作者：彭志伟（华中科技大学）

学位名称：博士

出处：华中科技大学

关键词：石油期货；影响因素；价格发现；波动性；相关性；预测

[学位论文] 台湾期货市场日内交易之资讯传递效率与学习

作者：苏欣玫（淡江大学）

学位名称：博士

出处：淡江大学

关键词：日内资料；资讯传递效率；学习假说；买卖价差

[学位论文] 中国玉米期货市场与农户价格风险研究

作者：郑春风（吉林大学）

学位名称：博士

出处：吉林大学

关键词：中国；玉米期货市场；农户价格；风险

[学位论文] 粮食价格：政府与市场：兼论粮食期货市场的作用

作者：吴坚（浙江大学）

学位名称：博士

出处：浙江大学 2000

关键词：粮食价格；政府；价格理论；西方经济学

[学位论文] 中国股票指数期货：标的指数与合约设计

作者：章飏（厦门大学）

学位名称：博士

出处：厦门大学 2001

关键词：指数；指数期货；合约设计

[学位论文] 我国推出股指期货的理论研究及模式设计

作者：孙红波（华中科技大学）

学位名称：博士

出处：华中科技大学

关键词：股指期货；套利与套保；模式设计；风险控制

[学位论文] 已实现波动度於动态期货避险之应用

作者：赖雨圣（交通大学）

学位名称：博士

出处：交通大学

关键词：动态避险比率；多变量波动度模式；已实现波动度；避险绩效

[学位论文] 中国期货市场信息生态理论、模型与环境建设研究

作者：张玉智（吉林大学）

学位名称：博士

出处：吉林大学

关键词：期货市场；信息场；信息生态；信息生态环境

[学位论文] 中国期货市场运行与发展的经济学分析

作者：沈开艳（上海社会科学院）

学位名称：博士

出处：上海社会科学院 2001

关键词：期货市场；中国期货市场

[学位论文] 受限未定权益的定价与期货市场的风险利润分析

作者：杨峰（山东大学）

学位名称：博士

出处：山东大学 1998

关键词：未定权益；弹性约束；交易量；未平仓合约；风险利润

[学位论文] 台湾期货交易所选择权投资人的交易行为

作者：王铭骏（政治大学）

学位名称：博士

出处：政治大学

关键词：行为财务学；框架效应；心理帐户

[学位论文] 日本 TOCOM 及美国 COMEX 黄金与白银期货的动态关系、风险值与门槛效果之实证研究

作者：林惠娜（淡江大学）

学位名称：博士

出处：淡江大学

关键词：GARCH；Copula 函数；外溢效果；Kendall；tau；风险值；门槛效果

[学位论文] 商品市場與要素市場不確定下廠商期貨避險行為之經濟分析

作者：拾己宇（中国文化大学）

学位名称：博士

出处：中国文化大学 1986

关键词：商品市場不確定；要素市場不確定；雙邊不確定

[学位论文] 中国社会主义市场经济发展过程中期货市场研究

作者：徐正林（武汉大学）

学位名称：博士

出处：武汉大学

关键词：中国经济发展；期货市场

[学位论文] 景气循环、通货膨胀衡量及联邦资金利率期货三论

作者：颜承晖（台湾大学）

学位名称：博士

出处：台湾大学

关键词：景气循环；投资组合管理；频谱分析；指数随机方法；联邦资金利率期货；方向性预测准确性

[学位论文] 电子化交易与公开喊价交易指数期货市场微结构之研究

作者：姜淑美（淡江大学）

学位名称：博士

出处：淡江大学

关键词：电子期货契约；价格投机及不稳定效果；价格丛聚；市场微结构

[学位论文] 指数期货、交易量及技术分析研究--市场微结构观点

作者：许智翔（台湾大学）

学位名称：博士

出处：台湾大学

关键词：指数期货；交易量；技术分析；市场微结构

[学位论文] 美歐亞三洲股價指數期貨之報酬率預測 及報酬波動外溢效果

作者：孔令明（国立台湾科技大学）

学位名称：博士

出处：国立台湾科技大学 1995

[学位论文] 不對稱資訊狀況下,外匯市場匯出管制,時差問題,指數期貨,對股票市場之影響

作者：絲文銘（国立台湾大学）

学位名称：博士

出处：国立台湾大学 1986

关键词：匯出管制；開市順序；指數期貨；異質性解讀

[学位论文] 大豆期货价格波动率预测

作者：林学贵（上海财经大学）

学位名称：博士后

出处：上海财经大学 2003

关键词：期货价格；波动率预测；大豆期货

[学位论文] 风险承受度与获利的关系：期货市场投资人逐笔交易的检测

作者：郑登元（成功大学）

学位名称：博士

出处：成功大学

三、结语

期货学位论文集中在哪些高校，各个高校的优势方向如何，纲举目张，一目了然，为我们从事期货相关算法应用做了比较好的指引。

四、参考文献

[1] 超星发现系统[EB/OL].<http://www.chaoxing.com/>

[2] 百度词条