



AUTORITÉ
DES MARCHÉS FINANCIERS

Impression à partir d'une page du site internet de l'AMF

12 mars 2019

Comportement agressif des participants de marché : les HFT traitent-ils au moment opportun ?

Cette étude de microstructure analyse les ordres dits agressif des participants de marché sur les valeurs liquides d'Euronext Paris sur une période de 3 mois, entre septembre 2017 et novembre 2017. Son objectif est d'un côté de quantifier l'impact de ces ordres sur la formation des prix, et de l'autre côté d'estimer l'avantage informationnel des traders haute fréquence par rapport aux autres participants de marché. (La version française en résumant les principales constatations, se référer à la version anglaise pour accéder à l'étude entière).

 Télécharger le contenu

Mots clés

MARCHÉS

MICRO-STRUCTURE

SUR LE MÊME THÈME



S'abonner à nos alertes et flux RSS

RÈGLES PROFESSIONNELLES

MARCHÉS

18 mai 2022

Décision du 26 avril 2022 relative à la modification des règles de fonctionnement du système multilatéral de négociation (SMN) opéré par TP ICAP (Europe) S.A.



RÈGLES PROFESSIONNELLES

MARCHÉS

19 avril 2022

Décision du 29 mars 2022 relative à la modification des règles de fonctionnement du système multilatéral de négociation (SMN) Aquis Exchange Europe visant le carnet d'ordre à...



RÈGLES PROFESSIONNELLES

MARCHÉS

19 avril 2022

Décision du 29 mars 2022 relative à la modification de la partie harmonisée des règles de de fonctionnement du système multilatéral de négociation (SMN) Euronext Growth



Mentions légales :

Responsable de la publication : Le Directeur de la Direction de la communication de l'AMF. Contact : Direction de la communication, Autorité des marchés financiers - 17, place de la Bourse - 75082 Paris Cedex 02