



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

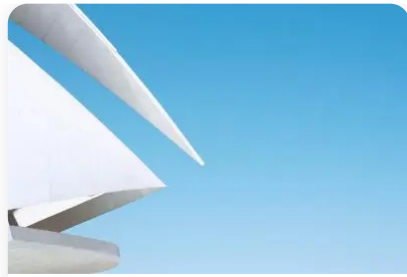
MARCHÉS

MICRO-STRUCTURE

SUR LE MÊME THÈME

 S'abonner à nos alertes et flux RSS



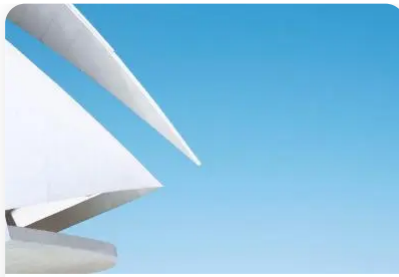


RÈGLES PROFESSIONNELLES

MARCHÉS

09 janvier 2025

Décision relative à diverses modifications des règles harmonisées (Livre I) des marchés réglementés opérés par Euronext Paris SA, concernant les dispositions relatives aux «...



RÈGLES PROFESSIONNELLES

MARCHÉS

11 décembre 2024

Décision relative à la modification des règles de fonctionnement de LCH SA sur le segment CDSClear, concernant certaines dispositions applicables aux Select Members



RÈGLES PROFESSIONNELLES

MARCHÉS

15 novembre 2024

Décision relative à la modification des règles de fonctionnement de la chambre de compensation LCH SA pour les services EquityClear et RepoClear, dans le cadre de l'entrée en...



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