

<<中国资本市场效率与监管研究>>

图书基本信息

书名：<<中国资本市场效率与监管研究>>

13位ISBN编号：9787302141389

10位ISBN编号：730214138X

出版时间：2006-12

出版时间：第1版 (2006年12月1日)

作者：孔淑红

页数：254

字数：344000

版权说明：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：<http://www.tushu007.com>

<<中国资本市场效率与监管研究>>

内容概要

全书共分11章，在详细全面介绍现代资本市场效率和监管理论的基础上，从无套利均衡实现的观点出发，运用市场效率理论和计量实证方法对尚处于初级发展阶段的中国资本市场进行了理论和实证研究，并为中国资本市场的规范建设、效率分析、监管模式和体系的发展方向提供了相应的政策建议。

本书可以作为高等院校经济管理类专业师生的专业参考书，也可供金融机构各类专业人员阅读参考。

<<中国资本市场效率与监管研究>>

书籍目录

引论第1章 资本资产定价模型 (CAPM) 1.1 资本化定价与内在价值 1.2 资本资产定价模型及其意义 1.3 资本资产定价模型的扩展 1.4 对资本资产定价模型的实证检验与质疑 1.5 中国证券市场应用CAPM的有关问题第2章 套利定价模型 (APT) 2.1 套利定价模型及其意义 2.2 套利定价模型的实证检验 2.3 CAPM与APT的关系与比较 2.4 无套利均衡分析方法 2.5 中国证券市场APT应用和无套利均衡实现的有关问题第3章 定价模型的应用与价格回归过程 3.1 CAPM的均衡价格与价格回归过程 3.2 APT的价格回归过程 3.3 价格回归过程与内在价值 3.4 价值回归与市场效率 3.5 中国证券市场的价值回归问题第4章 市场效率理论 4.1 市场效率理论及其意义 4.2 关于欧美现代资本市场有效性的实证研究综述第5章 中国证券市场均衡与效率的理论分析 5.1 中国证券市场均衡与效率研究回顾 5.2 从无套利均衡的观点看中国证券市场效率 5.3 中国证券市场均衡与效率研究方法第6章 中国证券市场弱式有效性的实证分析 6.1 中国证券市场股票收益率序列的随机游走检验 6.2 宏观经济运行状况与中国股市运行状况的长期关系检验 6.3 异象检验 6.4 中国证券市场弱式有效性实证检验结论分析第7章 中国证券市场半强式有效性的实证分析 7.1 中国证券市场2001年盈余信息公告的收益率漂移效应实证研究 7.2 中国股市年报盈余信息反应的M-EGARCH模型实证研究及相关结论 7.3 中国证券市场半强式有效性的实证结论分析第8章 中国证券市场上内幕信息、庄股行为实证研究与强式有效特征分析 8.1 中国证券市场庄股行为分析 8.2 政策信息与庄股行为关系的实证分析 8.3 庄股出货阶段超常收益率与累积超常收益率的实证研究 8.4 关于中国证券市场强式效率状况的实证结论分析第9章 中国证券市场均衡建立与效率研究的结论分析 9.1 中国证券市场无套利均衡的建立与市场效率状况分析 9.2 中国证券市场无套利均衡建立的障碍分析 9.3 中国证券市场低效率的原因分析第10章 基于市场效率的中国资本市场监管模式、体系建设 10.1 资本市场监管与市场效率的关系 10.2 中西方资本市场监管的理念、体制、模式比较 10.3 中国资本市场监管体系的演变与发展方向第11章 中国证券市场均衡建立与提高效率的有关政策建议 11.1 中国证券市场体制性缺陷及其改进的政策建议 11.2 加强中国证券市场规范与监管的政策建议 11.3 推进中国证券市场国际化发展的政策建议附录参考文献

版权说明

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:<http://www.tushu007.com>