

<<证券市场微观主体行为研究>>

图书基本信息

书名：<<证券市场微观主体行为研究>>

13位ISBN编号：9787308075060

10位ISBN编号：7308075060

出版时间：2010-6

出版时间：浙江大学出版社

作者：陈超

页数：196

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>

## <<证券市场微观主体行为研究>>

### 内容概要

研究和分析市场微观结构对中国股票市场的发展有重大意义。

它既需要理论工作者定量研究中国股票市场的流动性、波动性和透明度等一系列技术指标，也需要监管层从长远利益出发考虑市场微观结构的改革和发展。

中国股票市场的改革必然是在规范中求发展，在发展中求规范，只单独强调某一方面必将更大程度伤害投资者的利益。

本书从市场参与者(上市公司、投资者等)的行为和市场本身特性对中国证券市场的微观结构进行理论与实证研究。

## <<证券市场微观主体行为研究>>

### 作者简介

陈超，博士，副教授，硕士生导师。

中山大学经济学博士后，中南大学理学博士，浙江万里学院副教授，河北工业大学硕士研究生导师。

浙江省151人才培养对象，宁波市4321人才培养对象。

主持省部级科研课题6项，在《数量经济技术经济研究》、《工程数学学报》、《管理工程学报》等国家核心期刊发表论文60余篇。

## &lt;&lt;证券市场微观主体行为研究&gt;&gt;

## 书籍目录

01 绪论 1.1 研究背景 1.2 研究意义 1.3 研究思路、研究内容与创新点 1.3.1 研究思路 1.3.2 研究方法 1.3.3 研究内容 1.3.4 创新点

02 证券市场和市场主体行为 2.1 中国证券市场的发展历程 2.1.1 改革开放前的中国证券市场 2.1.2 改革开放后中国证券市场的复苏和起步(1980—1991年) 2.1.3 中国证券市场的快速发展(1992—1998年) 2.1.4 中国证券市场的规范调整和改革深化(1999—2008年) 2.2 证券市场的主体行为 2.2.1 投资者行为 2.2.2 上市公司行为 2.2.3 中介机构行为 2.2.4 监管者行为

03 金融分析中的非经典数据模型 3.1 面板数据模型 3.1.1 面板数据模型简介 3.1.2 固定效应模型及其估计方法 3.1.3 随机效应模型及其估计方法 3.1.4 模型设定的检验 3.2 离散选择模型 3.2.1 二元离散选择模型 3.2.2 二元Probit离散选择模型及其参数估计 3.2.3 二元Logit离散选择模型及其参数估计 3.2.4 二元离散选择模型的变量显著性检验 3.3 高频数据及相关模型 3.3.1 高频数据概述 3.3.2 高频数据的特点 3.3.3 高频数据模型

04 上市公司：治理结构的有效性 4.1 背景与问题的提出 4.1.1 全球性的公司治理浪潮 4.1.2 为什么要关注公司治理问题 4.1.3 问题的提出 4.2 公司治理概述 4.2.1 公司治理的概念 4.2.2 公司治理的属性特征 4.2.3 公司治理的内容体系 4.2.4 公司治理的模式 4.3 公司治理结构有效性的研究综述 4.4 股权结构的有效性 4.4.1 股权结构的定义 4.4.2 股权结构与经营绩效的研究假设 4.4.3 实证研究采用的方法——面板数据模型 4.4.4 变量选取与数据处理 4.4.5 实证结果 4.5 董事会治理的有效性 4.5.1 董事会治理定义 4.5.2 研究概况 4.5.3 研究假设 4.5.4 研究设计 4.5.5 实证结果分析 4.6 经营者激励机制的有效性 4.6.1 经营者激励机制概述 4.6.2 激励机制有效性的实证检验 4.6.3 实证结果 4.7 现代企业中治理结构的现状

05 证券投资基金：行为策略与价格影响 5.1 证券投资基金 5.1.1 证券投资的概念 5.1.2 证券投资基金的发展 5.1.3 证券投资基金与股票、债券的区别 5.1.4 证券投资基金的特点 5.1.5 发展证券投资基金的作用 5.1.6 证券投资基金与中国的证券市场 5.2 证券投资基金交易行为对股价的影响 5.2.1 历史文献的简单回顾 5.2.2 基金交易行为对股票收益的影响分析 5.2.3 基金交易行为对股票波动的影响分析 5.2.4 基金交易行为对股票换手率的影响分析 5.3 证券投资基金的持股特征 5.3.1 历史文献回顾 5.3.2 基金持股特征的实证分析 5.3.3 基金增减仓影响因素的实证分析

06 市场价格行为：效率、波动与交易持续性 6.1 中国股票市场的弱式有效检验 6.1.1 有效市场理论概述 6.1.2 中国证券市场有效性检验的回顾 6.1.3 证券市场弱式有效的游程检验方法 6.1.4 沪深股市弱式有效的实证检验 6.1.5 中国股市非有效的原因分析 6.2 中国股票市场的(超)高频波动 6.2.1 中国股票市场的日内波动特征研究 6.2.2 中国股票市场的实际波动特征研究 6.3 中国股票市场的交易持续性研究 6.3.1 ACD模型的产生背景 6.3.2 ACD模型族及其设定检验 6.3.3 沪深300指数的交易持续性

07 证券市场主体行为规范 7.1 上市公司行为规范 7.1.1 上市公司行为缺陷原因 7.1.2 上市公司行为规范机制 7.2 证券投资基金行为规范 7.2.1 证券投资基金行为缺陷原因 7.2.2 证券投资基金行为规范机制 7.3 证券中介机构行为规范 7.3.1 证券中介机构行为不规范表现 7.3.2 证券中介机构行为规范机制 7.4 证券监管机构行为规范 7.4.1 证券监管机构行为存在的问题 7.4.2 证券监管机构行为规范机制

参考文献

<<证券市场微观主体行为研究>>

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>