

图书基本信息

书名：<<中国证券市场流动性溢价及其稳定性和效应计量研究>>

13位ISBN编号：9787500495659

10位ISBN编号：750049565X

出版时间：2011-3

出版时间：中国社会科学出版社

作者：佟孟华

页数：343

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>

内容概要

在国内外研究的基础上，该学术专著全面地综合性地研究了我国证券市场流动性溢价的存在性及其特征，研究了流动性溢价的稳定性效应以及流动性溢价的动态波动性及系统流动性风险和流动性之间的关系，填补了这一领域多项研究空白，不仅具有理论价值而且具有十分广泛的应用价值。

作者简介

佟孟华，教授，博士。

1965年出生于吉林省白城市，1982年考入吉林大学数学系，1986年6月获得理学学士学位，1998年获得东北财经大学经济学硕士学位，2006年12月获得东北财经大学数量经济学博士学位，2009年吉林大学应用经济学博士后出站。

现任职于东北财经大学数学与数量经济学院，从事数理金融学的教学和科研工作，主授课程：数理金融、金融经济学和实证金融。

研究方向：数理金融与实证金融。

在《当代经济》等国内期刊上发表论文30多篇，出版专著一部，曾主持完成国家社会科学基金项目一项，参与多项国家级、省级和市级科研课题的研究工作。

书籍目录

- 序
- 前言
- 第一章 绪论
 - 一 问题的提出
 - 二 研究思路与研究结构
- 第二章 流动性溢价的相关研究综述与评论
 - 一 国外与流动性溢价相关的理论研究评述
 - 二 与流动性溢价相关的实证研究评述
 - 三 国内关于流动性研究的文献评述
- 第三章 流动性溢价与流动性风险溢价基本理论与模型
 - 一 流动性概念的界定与内涵
 - 二 流动性的度量方法
 - 三 证券市场流动性溢价相关模型评述
 - 四 流动性风险与流动性风险溢价基本理论
- 第四章 中国股票市场流动性溢价存在性的实证研究
 - 一 基于个股数据的流动性溢价存在性研究
 - 二 基于市场数据的流动性溢价存在性研究
 - 三 小结
- 第五章 中国股票市场流动性溢价稳定性研究
 - 一 基于个股数据的不同市场态势下流动性溢价稳定性检验
 - 二 基于个股数据的不同政策和重大事件下流动性溢价稳定性检验
 - 三 基于行业数据对流动性溢价稳定性的检验
 - 四 小结
- 第六章 基于流动性溢价的股市相关效应研究
 - 一 基于流动性溢价的股市“规模效应”研究
 - 二 流动性溢价“月份效应”研究
 - 三 小结
- 第七章 股票市场流动性与及其收益波动动态关系研究
 - 一 引言
 - 二 研究方法介绍
 - 三 实证分析
 - 四 小结
- 第八章 上证所国债市场流动性与收益动态关系研究
 - 一 引言
 - 二 样本及变量选取
 - 三 基本检验结果
 - 四 国债市场流动性与收益动态关系实证研究
 - 五 小结
- 第九章 流动性对股票价格波动影响的实证研究
- 第十章 股市系统流动性风险溢价动态实证研究
- 结论与政策建议
- 附表
- 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>