

<<中国股票市场的系统风险与回报研>>

图书基本信息

书名：<<中国股票市场的系统风险与回报研究>>

13位ISBN编号：9787501787302

10位ISBN编号：7501787301

出版时间：2008-6

出版时间：中国经济出版社

作者：刘仁和

页数：246

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>

<<中国股票市场的系统风险与回报研>>

内容概要

《中国股票市场的系统风险与回报研究》多年来，股票市场贝塔的稳定性的稳定性一直困扰着投资界和理论界。

《中国股票市场的系统风险与回报研究》从个股贝塔稳定性、组合贝塔稳定性、个股与股票组合贝塔系数变动的方向三个角度研究中国股票市场系统性风险的稳定性，并希望找到稳定贝塔的估计方法。同时，《中国股票市场的系统风险与回报研究》应用不同于一般计量经济学的方差分解方法，研究红利与投资者预期收益率对中国股市波动的影响程度以及中国股票市场是否存在财富效应的问题。

作者简介

刘仁和，湖南双峰人，华南农业大学经济管理学院金融系副主任，副教授，硕士生导师，注册会计师。

复旦大学经济学博士，曾在南方证券等机构从事资本市场研究与投资银行工作。

研究领域：资产定价、金融经济学与行为金融学。

目前主持一项国家自然科学基金项目、一项教育部人文社科基金项目 and 一项广东省社科基金项目等。

在《改革》、《经济学动态》等刊物发表论文20余篇，出版专著一部。

书籍目录

第一篇 导论1 中国股票市场风险与回报统计分析1.1 市场指数与市值规模变化1.2 股票收益率的统计分析1.3 市场风险与收益第二篇 中国股票市场系统风险稳定性研究2 研究综述2.1 国外研究现状2.2 国内研究现状2.3 简要评述3 贝塔估计模型的选择与实证设计3.1 贝塔系数及其意义3.2 贝塔系数的估计模型3.3 研究设计4 贝塔系数稳定性的实证结果及分析4.1 股票各月度贝塔系数的估计结果分析4.2 个股总波动性（稳定性）的度量4.3 组合贝塔值稳定性研究4.4 个股与组合贝塔的回归趋势4.5 小结5 结论与讨论5.1 结论5.2 讨论附录第三篇 是什么引起了中国股票市场波动6 研究综述6.1 国外研究现状6.2 国内研究现状6.3 小结7 实证设计7.1 动态戈登增长模型7.2 收益率方差分解模型8 实证结果及分析8.1 数据来源8.2 变量的设计与计算8.3 时间序列的平稳性检验8.4 VAR系统的检验8.5 收益的方差分解9 结论与讨论9.1 结论9.2 需要进一步讨论的问题附录第四篇 中国股票市场波动对消费的影响：财富效应研究10 导言11 实证设计11.1 什么是财富效应11.2 影响财富效应的因素11.3 数据选取与计量模型的构建11.4 计量模型的建立12 实证结果及分析12.1 输入数据进行分析12.2 对初步计量模型进行修正及结果输出12.3 对修正计量模型的检验12.4 实证分析总结13 结论与启示13.1 中国股票市场是否存在财富效应13.2 国内外股票市场财富效应的比较13.3 各个时期货币政策的有效性13.4 政策建议附录参考文献后记

编辑推荐

《中国股票市场的系统风险与回报研究》共有“导论”、“中国股票市场系统风险稳定性研究”、“是什么引起了中国股票市场波动”、“中国股票市场波动对消费的影响：财富效应研究”这四篇。

第一篇、第二篇主要研究我国股票市场系统风险的稳定性。

第三篇应用不同于一般计量经济学的方差分解方法，研究我国股市非预期收益波动的驱动因素。

第四篇研究我国股票市场波动对消费的影响。

与国内大部分研究结论不同的是，我们的实证分析结果拒绝了财富效应假设。

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>