

<<金融市场有效性探讨>>

图书基本信息

书名：<<金融市场有效性探讨>>

13位ISBN编号：9787810985376

10位ISBN编号：781098537X

出版时间：2005-12

出版时间：上海财经大学出版社

作者：戴国强/徐龙炳/陆蓉

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>

## <<金融市场有效性探讨>>

### 内容概要

传统的金融理论是以货币和银行为核心而建立起来的。

这种理论构架充分反映了在市场信息不完全条件下，银行业受到垄断性保护、间接金融占压倒优势的实际情况。

因此，传统的金融理论能适应20世纪70年代以前经济与金融发展的需要。

本书是国家“十五”重点图书，金融理论前沿丛书之一。

本书不仅展示了金融市场特性的争论热点，而且通过对中国金融市场的实证研究，对相关理论提出了质疑。

作者分别就中国股票市场协整性研究、周末效应研究、非线性研究、稳态性研究等问题展开讨论，并对宏观经济计量模型的最新发展作了介绍，对货币供给与GDP关系实证分析。

全书融合了国内外最新研究成果，并具有独到的见解，适合金融理论工作者、高校金融相关专业的师生参考。

## <<金融市场有效性探讨>>

### 作者简介

戴国强，男，1952年6月生于上海。

1983年1月毕业于上海财经学院获经济学学士，1987年毕业于上海财经大学获经济学硕士，1994年毕业于复旦大学获经济学博士。

现任上海财经大学金融学院院长、教授、中国金融学会常务理事、中国金融学会学术委员会委员、上海国际金融研究中心副主任、上海金融学会副会长、上海城市金融学会副会长。

先后在新加坡国立大学、纽约大学、NBER做访问学者。

主要研究方向为货币理论和银行管理理论。

主要学术成果有《中国货币需求分析》、《金融市场微观结构理论》、《金融是现代经济的核心》、《商业银行经营创新》、《2000中国金融发展报告》、《2005中国金融发展报告》、《论凯恩斯“准繁荣”思想及其对通货膨胀的态度》、《中国股票市场周末效应》、《论我国货币市场发展的框架和实现路径》等，论文主要刊登在《经济研究》、《金融研究》、《经济学动态》、《学术月刊》、《国际金融研究》和《财经研究》等学术期刊上。

主编《货币银行学》、《商业银行经营学》等全国统编教材。

主持国家自然科学基金课题2项和省部级课题7项。

曾获得全国高校人文社会科学优秀成果三等奖、上海市哲学社会科学优秀成果一等奖、三等奖，中国人民银行总行优秀成果二等奖、优秀教材二等奖，上海市优秀教材奖。

## <<金融市场有效性探讨>>

### 书籍目录

主编寄语第一章 有效市场理论产生、发展及其争论 一、EMH的产生 二、EMH的实证含义 三、EMH的分类及其检验 四、EMH的发展 五、关于EMH的争论 六、对EMH的几点想法第二章 中国股票市场协整性研究 一、单整检验——检验单位根 二、协整性检验 三、Granger因果性关系检验 四、波动性分析讨论 五、结论第三章 中国股票市场周末效应研究 一、中国股市股票收益率的描述统计 二、研究方法的选择 三、实证研究 四、研究结果 五、对上海股票市场的进一步讨论 六、说明第四章 中国股票市场非线性研究：R/S分析 一、R/S分析法 二、实证研究 三、结果分析第五章 中国股票市场非线性研究：BDS检验 一、BDS检验 二、实证研究 三、结论第六章 中国股票市场稳态特性研究 一、股票收益的描述统计分析 二、稳态分布的基本特性 三、实证研究 四、结果分析第七章 国际汇率波动非线性研究：R/S分析 一、实证研究 二、结果分析 三、汇率波动非线性的政策意义第八章 国际汇率波动稳态特性研究 一、汇率及其收益的基本统计 二、实证研究 三、结果分析 四、政策建议第九章 经济系统的非线性：混沌与分形 一、混沌、分形及其意义 ..... 第十章 宏观经济计量模型的最新发展第十一章 货币供给与GDP关系实证分析第十二章 机构投资者与股票价格波动研究进展第十三章 机构投资者投资行为分析第十四章 中国股票市场机构投资者多账户交易实证研究参考文献

<<金融市场有效性探讨>>

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>