

图书基本信息

书名：<<限售股解禁与减持对股票市场影响的实证研究>>

13位ISBN编号：9787811139129

10位ISBN编号：781113912X

出版时间：2010-11

出版时间：湖南大学出版社

作者：潘焕焕

页数：128

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

《限售股解禁与减持对股票市场影响的实证研究》通过描述性统计与事件研究等多种量化分析方法，多角度对限售股解禁与减持压力来源进行较为系统的比较研究，并利用行为金融学相关理论分析了不同投资者的行为特征，进而提出化解市场冲击的政策建议。适合广大股民及有志金融方面研究人士参阅。

## 书籍目录

第1章 绪论	1.1 研究背景与意义	1.1.1 研究背景	1.1.2 研究意义	1.2 我国股改限售股解禁问题历史沿革	1.3 相关文献评述	1.3.1 解禁相关实证研究	1.3.2 减持相关实证研究	1.3.3 观点综述	1.3.4 现有研究存在的问题	1.4 本研究的创新之处	1.5 内容安排												
第2章 限售股解禁与减持的数据统计分析	2.1 限售股类别分析及其解禁规模的时间分布	2.1.1 股改限售股	2.1.2 IPO限售股	2.1.3 增发限售股	2.1.4 分析结论	2.2 限售股解禁前后的市场表现	2.2.1 2007—2009年限售股解禁前后的表现	2.2.2 不同时期内限售股解禁前后的分类表现	2.2.3 分析结论	2.3 限售股减持前后的市场表现	2.3.1 不同股东类型的限售股减持数量的分时间段统计	2.3.2 不同股东类型限售股减持和市场反应对比	2.3.3 不同减持规模市场反应对比	2.3.4 分析结论									
第3章 限售股解禁与减持对股价走势的影响	3.1 限售股解禁对股价走势的影响	3.1.1 研究假设	3.1.2 数据准备	3.1.3 回归分析结果	3.2 限售股减持对股价走势的影响	3.2.1 研究假设	3.2.2 数据准备	3.2.3 回归分析结果	3.3 小结	第4章 限售股解禁与减持对大盘的影响	4.1 研究方法	4.1.1 协整分析	4.1.2 Granger因果关系检验	4.2 限售股解禁对大盘影响的实证分析	4.2.1 样本量化指标及数据的选取	4.2.2 实证检验结果与分析	4.3 限售股减持对大盘影响的实证分析	4.3.1 样本量化指标及数据的选取	4.3.2 实证检验结果与分析	4.4 小结			
第5章 限售股解禁与减持的市场冲击效应研究	5.1 事件研究法(event study)的基本原理	5.2 限售股解禁冲击的事件研究模型	5.3 限售股解禁冲击效应的实证分析	5.3.1 解禁冲击效应的总体特征	5.3.2 市场冲击效应的结构性分析	5.4 限售股减持冲击的事件研究模型	5.5 限售股减持冲击效应的实证分析	5.5.1 减持冲击效应的总体特征	5.5.2 减持冲击事件研究结果及分析	5.6 小结	第6章 限售股解禁对投资者行为的影响分析	6.1 限售股解禁背景下中国股市的“羊群行为”分析	6.2 限售股解禁对基金行为影响的实证检验	6.2.1 假设	6.2.2 样本选取和研究变量说明	6.2.3 描述性样本统计分析	6.2.4 回归分析	第7章 总结与政策建议	7.1 实证研究结论	7.2 政策建议	7.2.1 境外市场应对限售股解禁冲击的经验考察	7.2.2 化解我国限售股解禁与减持冲击的建议	
参考文献 后记																							

编辑推荐

本研究样本数据选取范围广泛、代表性强，在研究我国限售股解禁与减持压力时，采用了一些特征标准（解禁与减持股属性、解禁与减持时间、解禁与减持比例、股本）进行分组测度，并分别对特征组别间的差异进行了分析，研究不同限售股类型和不同减持股东类型对股票市场影响程度的不同，多角度对限售股解禁与减持压力来源给予较为系统的比较研究。

本研究在多角度分析限售股解禁与减持对市场价格与投资者行为影响的基础上，提出化解市场冲击的政策建议，更有针对性和可操作性。

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>