

<<中国股票市场定价泡沫研究>>

图书基本信息

书名：<<中国股票市场定价泡沫研究>>

13位ISBN编号：9787509615263

10位ISBN编号：7509615267

出版时间：2012-1

出版时间：经济管理出版社

作者：李捷瑜 等著

页数：182

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>

<<中国股票市场定价泡沫研究>>

内容概要

“泡沫”一词频繁出现在人们对金融资产的议论当中，然而，泡沫是否存在，如何形成，在学术界一直是饱受争议的问题。

李捷瑜等编著的《中国股票市场定价泡沫研究》基于意见分歧理论，结合制度特征和投资者行为特点研究中国股票市场的定价泡沫，从中发现，意见分歧和买空受限是导致投机泡沫长期存在的关键因素；泡沫削弱了股票市场资源配置功能，继而对上市公司真实投资水平以及范围选择都造成了扭曲。

《中国股票市场定价泡沫研究》从微观角度帮助人们深入了解和把握泡沫的内在机制和影响。

<<中国股票市场定价泡沫研究>>

书籍目录

- 导论
 - 0.1 研究动机与研究意义
 - 0.2 重要概念的界定
 - 0.3 研究方法与本书结构
 - 0.4 观点与证据
- 第1章 资产定价泡沫研究的历史变迁
 - 1.1 有效市场假说与传统资产定价模型
 - 1.2 资产定价泡沫的理论观点
 - 1.3 意见分歧对资产定价及交易活动的影响
- 第2章 投机泡沫的影响与抑制
 - 2.1 资产定价泡沫与行为公司财务
 - 2.2 投机泡沫的抑制与投机市场中的监管
- 第3章 理论模型：意见分歧、投机交易与投机泡沫
 - 3.1 引言
 - 3.2 模型假定
 - 3.3 $t=1$ 时刻的投资者决策与均衡价格
 - 3.4 $t=0$ 时刻的投资者决策、均衡价格及泡沫成分
 - 3.5 价格波动率、期望换手率及其与投机泡沫的关系
 - 3.6 小结
- 第4章 经验分析：换手率、流通量与预期收益
 - 4.1 引言
 - 4.2 换手率、非流动性成本与横截面预期收益
 - 4.3 换手率与流通量的关系
 - 4.4 小结
- 第5章 投机泡沫的膨胀与破灭
 - 5.1 历史上著名的股市泡沫事件
 - 5.2 AK历史泡沫事件总结的深层次特征
 - 5.3 理论解释：意见分歧的变化导致泡沫的膨胀与破灭
 - 5.4 中国股市投机泡沫的演变过程——基于机制转换模型的研究
 - 5.5 小结
- 第6章 投机泡沫对上市公司真实投资的影响
 - 6.1 引言
 - 6.2 理论回顾：股票价格、投机泡沫与真实投资
 - 6.3 经验证据
 - 6.4 小结
- 第7章 市场价值、生产效率与上市公司多元化经营
 - 7.1 引言
 - 7.2 文献评述
 - 7.3 理论模型
 - 7.4 实证方法与数据
 - 7.5 实证结果与分析
 - 7.6 小结
- 第8章 交易税费对股票波动率和换手率的影响
 - 8.1 引言
 - 8.2 引入交易税费的投机模型

<<中国股票市场定价泡沫研究>>

- 8.3 印花税调整效应的再检验
- 8.4 小结
- 第9章 内幕交易、利益冲突与公司治理
 - 9.1 引言
 - 9.2 理论回顾与假说设立
 - 9.3 样本资料来源
 - 9.4 内幕交易的存在性检验
 - 9.5 公司治理与内幕交易关系的实证分析
 - 9.6 小结
- 第10章 结论与启示
 - 10.1 研究结论与政策建议
 - 10.2 进一步研究的方向
- 附录
 - 附录I：第3章命题的证明
 - 附录：机制转换模型(5—5)的推导
 - 附录：第5章 中三个模型的估计结果
 - 附录：第5章 中市场实际大幅下挫的日期与收益
 - 附录V：第6章 中 O_j 的计算公式
 - 附录：第7章 命题7—2的证明
 - 附录：第7章 cobb—Douglas生产函数估计结果
- 参考文献
- 后记

<<中国股票市场定价泡沫研究>>

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>