

<<中国证券市场监管的博弈研究>>

图书基本信息

书名：<<中国证券市场监管的博弈研究>>

13位ISBN编号：9787564211066

10位ISBN编号：7564211067

出版时间：2012-1

出版时间：上海财经大学出版社有限公司

作者：王家辉

页数：162

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>

## <<中国证券市场监管的博弈研究>>

### 内容概要

本书的创新主要在：第一，分析方法具有前沿性。

本书使用博弈理论所建立的证券市场监管行为的博弈分析模型，能够有效地揭示监管者与被监管者之间的博弈行为以及寻租、合谋行为，还用实验经济学的方法在实验室中进行真人受控实验，不仅可以观察到现实生活中难以观察到的寻租、合谋行为，而且通过参数控制，比较发现影响寻租行为的主要因素。

第二，本书的结论具有一定的可操作性，不但可以用来指导证券行业监管制度的设计、制度安排，还可以应用于银行监管、保险监管的机制设计和制度安排。

第三，通过实验室真人受控实验研究，清楚地发现寻租、合谋行为在长期重复博弈过程中会建立相互信任和互惠互利的利益团体。

互惠互利局面的形成在很大程度上是由于监管机制不合理、监管力度不够、惩罚难以落实。

结合我国当前证券市场及其管理体系的情形，我国应该尽快完善证券监管立法，使得监管有据、处罚有度，从源头上杜绝钻法律空子的扰乱证券市场的违法行为；应该健全、完善行政监管，充分发挥行业自律组织的作用，大大增强财经专家与新闻媒体的结合，共同对证券市场进行最为全面、有效的监督，降低监管成本。

本书共分七章。

第一章导言，提出问题。

第二章监管理论综述；概述和评论各种学派观点。

第三章、第四章是本书的重点和难点，分别研究证券监管的博弈行为，试图用具体模型对证券市场诸如寻租、合谋等现象进行本质揭示。

第五章笔者提出关于中国证券市场监管体系建设的看法，即要在加强法制建设的基础上，充分发挥专家监管低成本的优点，借助新闻媒体的力量对证券市场进行监督。

第六章是证券监管寻租、合谋问题的实验研究，用实验经济学的方法对理论上的假设进行可控条件下的模拟实验。

第七章为研究的总结和展望，对本书的主要结论做一个归纳，并提出研究中存在的不足以及有待进一步研究的问题。

# <<中国证券市场监管的博弈研究>>

## 书籍目录

### 前言

#### 1 引言

- 1.1 选题背景和研究意义
- 1.2 本书的创新点
- 1.3 经济管制的说明

#### 2 证券监管的理论回顾和个人观点

- 2.1 证券监管的理论回顾
- 2.2 股票价格的心理预期是市场失灵的重要原因
- 2.3 股票内在价值的客观性
- 2.4 小结

#### 3 证券监管的博弈分析

- 3.1 博弈论
- 3.2 证券市场监管的静态博弈分析
- 3.3 证券监管的动态博弈
- 3.4 审批制下证券市场权力寻租的博弈分析

#### 4 证券市场合谋问题研究

- 4.1 委托—代理理论
- 4.2 上市公司的合谋行为
- 4.3 上市公司经营者合谋行为的防治

#### 5 中国证券监管体系的优化

- 5.1 我国证券监管体制的演变
- 5.2 证券市场监管体系的优化
- 5.3 小结

#### 6 证券监管寻租问题实验研究

- 6.1 实验经济学基本理论介绍
- 6.2 证券监管寻租问题实验模型
- 6.3 证券监管寻租问题实验结果

#### 7 总结与展望

- 7.1 本书的结论与启示
- 7.2 本书的不足和进一步研究的方面

### 参考文献

### 后记

## <<中国证券市场监管的博弈研究>>

### 章节摘录

尽管如此，仍然有许多学者对此持不同的看法，萨缪尔森认为，管制应该是政府颁布的，用来维护社会公正、公平的法律、规章、制度、条例的总和；尼德汉姆认为，管制是一个经济体运用各种方式和手段对另一个经济体施加影响的各种活动；斯通恩认为，管制是政府凭借国家机器对其他经济主体自由决策所实施的强制性约束。

米惕尼可则认为，管制是对某种偏离常理行为的约束和干预。

中国经济学家梁晓民认为，经济管制是政府通过价格决定、产品标准、市场准入及退出对经济活动的管理和限制；潘振民则认为，政府管制是政府在微观层次上对经济的干预。

而在中国传统习惯和现实生活中，人们常用的是管制和监管这样的字眼，规制只是学术讨论和交流中的一种规范术语。

当然，在人们的观念中，管制和监管仍有差别，管制比监管更有干预的含义。

管制代表着直接的管理和制约，而监管则更多的是一种外在的、根据规则进行监管和约束的活动。在现实中，常将政府对自然垄断部门、产生负的外部效应的部门（乃至所有产品市场）的约束称为管制，将对金融市场的约束称为监管，在劳动力市场上也常称为管制。

.....

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>