

<<计量经济模型在中国股票市场 >

图书基本信息

书名：<<计量经济模型在中国股票市场的应用>>

13位ISBN编号：9787509601242

10位ISBN编号：750960124X

出版时间：2008-1

出版时间：经济管理

作者：姜峰

页数：161

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>

## <<计量经济模型在中国股票市场 >>

### 内容概要

本书系统地阐述了国际学术界用来解释中国A、B股和A、H股价格差异的各种假说，并进行了理论模型推导。

借鉴动态组合分析的思想，按各因素构造动态组合的方法，通过因子分析进行实证分析。

通过面板数据的静态模型和动态模型两方面分析导致B股和H股折价的显著因素，并且在动态模型中应用广义矩估计法，有效克服了变量内生性问题，为我国股票市场走向成熟、规范、市场化、国际化提供一点参考。

## 作者简介

娄峰 安徽临泉人，1999年及2002年在大连理工大学先后获得学士学位和硕士学位；2005年在对外经济贸易大学获经济学博士学位，金融专业。

2005年至今，在中国社会科学院数量经济与技术经济研究所工作。

主要研究领域：宏微观经济建模、预测及预警，非参数与半参数计量经济学。

书籍目录

第一章 股票市场分割概述第一节 国际股票市场分割背景第二节 中国股票市场分割的概况第三节 中国A、B、H股股票市场与世界其他股票市场的比较第四节 中国股票市场B、H股折价率的特征第二章 国内外研究股票市场分割的成果评述第三章 双重上市公司A、B股和A、H股股票价格差异现象的理论假说及模型分析第一节 信息不对称假说及模型第二节 投资理念差异假说及模型第三节 流动性差异假说及模型第四节 需求差异假说及模型第四章 双重上市公司的A、B、H股价格差异行为的实证研究第一节 研究方法第二节 数据来源及数据处理第三节 实证变量选取第四节 因子分析 (Factor Analysis) 第五节 各影响因素的动态组合分析第六节 面板数据模型分析第五章 A、B、H股市场间的信息流分析及协整研究第一节 信息不对称与股票市场分割第二节 Granger因果检验与信息传递路径实证分析第三节 向量自回归 (VAR) 模型与信息流的分解第四节 双重上市公司A、B股和A、H股的协整关系实证分析第六章 结论附录参考文献

编辑推荐

股票市场分割概述，国内外研究股票市场分割的成果评述，双重上市公司A、B股和A、H股股票价格差异现象的理论假说及模型分析，A、B、H股市场间的信息流分析及协整研究等。希望本书的出版，能为我国股票市场走向成熟、规范、市场化、国际化提供一点参考。

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>