

<<中国证券市场流动性风险研究>>

图书基本信息

书名：<<中国证券市场流动性风险研究>>

13位ISBN编号：9787802305854

10位ISBN编号：7802305853

出版时间：2007-5

出版时间：社会科学文献出版社

作者：韩冬

页数：225

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>

## <<中国证券市场流动性风险研究>>

### 内容概要

流动性是证券市场的生命力所在，是资本市场成熟与否的重要标志之一，从某种意义上讲，“流动性是市场的一切”。

正是基于金融市场流动性风险日益加剧的现实情况以及目前国内相关理论研究的缺乏，《中国证券市场流动性风险研究-中国社会科学院金融研究所.博库》着力于从金融微观结构理论出发，以反映证券市场基本经济功能的最核心指标——流动性及流动性风险为核心，从实证和理论的角度揭示中国股市流动性风险的特征，主要内容包括流动性特征、流动性风险度量、流动性风险溢价及基于流动性风险的最优交易执行策略等。

# <<中国证券市场流动性风险研究>>

## 书籍目录

第一章 绪论第一节 研究背景——问题的提出第二节 研究方法第三节 相关理论及文献综述第四节 研究内容、架构与创新点第二章 流动性风险概述第一节 金融风险第二节 流动性风险的概念第三节 流动性与流动性风险的度量第四节 流动性风险的影响因素第五节 小结第三章 流动性特征研究——证券市场买卖价差分析第一节 流动性的时间序列分析第二节 流动性时间效应研究第三节 流动性成本——买卖价差成分分解研究第四节 小结第四章 流动性风险的特性——个别风险还是系统风险第一节 引言第二节 流动性指标选取和样本数据第三节 流动性的协同现象研究第四节 流动性协同现象的规模效应第五节 流动性协同现象的行业效应第六节 组合流动性的协同现象研究第七节 小结第五章 流动性风险的度量——L-VaR模型第一节 引言第二节 流动性风险的度量模型第三节 基于中国股市L-VaR模型的实证研究第四节 小结第六章 流动性风险与交易机制——涨跌停限制引起的流动性风险研究第一节 引言第二节 考虑涨跌停限制的收益率调整方法第三节 研究方法与实证设计第四节 考虑涨跌停限制的流动性风险的实证研究第五节 小结第七章 流动性风险与资产定价第一节 引言第二节 LACAPM模型第三节 基于无条件LACAPM模型的流动性风险溢价的实证研究第四节 小结第八章 流动性风险与日间最优执行策略第一节 引言第二节 国外相关研究综述第三节 离散型与连续型模型分析第四节 日间最优执行策略的实证研究第五节 小结第九章 结语第一节 本书的研究工作与主要结论第二节 政策建议攻读博士学位期间发表的论文与参加的科研项目致谢

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>