

图书基本信息

书名：<<中国债券拍卖发行的微观机理与实证研究>>

13位ISBN编号：9787514116441

10位ISBN编号：7514116443

出版时间：2012-3

出版时间：经济科学出版社

作者：夏晓华

页数：206

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>

<<中国债券拍卖发行的微观机理与实证>>

内容概要

本书运用债券拍卖理论和拍卖计量分析的最新研究成果，紧紧围绕拍卖研究中最重要收益与效率问题，以估计中国债券投资者私人信息为出发点，从私人信息影响市场均衡的微观机理切入主题，在充分考虑中国债券市场制度特征的基础上，对我国债券市场均衡行为和市场特征做了系统分析。

书籍目录

第1章 导论

- 1.1问题的提出和选题背景
- 1.2债券拍卖发行的国际实践
- 1.3研究目的与意义
- 1.4研究出发点、内在逻辑与方法
- 1.5研究内容与章节安排
- 1.6本书的创新与贡献

第2章 理论背景与新近发展：文献综述

- 2.1引言
- 2.2拍卖理论中的信息假设
- 2.3多单位拍卖中的需求减少与抑价
- 2.4债券拍卖方式的收益比较
- 2.5债券拍卖方式的效率分析
- 2.6拍卖计量理论回顾
- 2.7拍卖与最优机制设计
- 2.8国内相关研究文献

第3章 中国债券拍卖的极值需求与市场势力

- 3.1引言
- 3.2博弈模型与估计方法
- 3.3数据处理与实证分析
- 3.4主要结论

第4章 债券拍卖投资者的非对称性与需求策略差异

- 4.1引言
- 4.2基本模型与CSE均衡
- 4.3估计方法说明
- 4.4数据处理与估计
- 4.5估计结果的运用
- 4.6主要结论

第5章 债券拍卖中的随机冲击、信息传导与收益比较

- 5.1引言
- 5.2基本模型
- 5.3风险中性下的均衡分析
- 5.4风险规避下的均衡分析
- 5.5收益比较
- 5.6模型校准与数值模拟
- 5.7主要结论

第6章 债券拍卖发行的效率问题

- 6.1引言
- 6.2基本模型
- 6.3数据分析与债券异质性处理
- 6.4投资者最高报价策略分析
- 6.5效率分析
- 6.6结论与评论

第7章 主要结论、政策建议与研究展望

- 7.1主要结论

7.2 政策建议

7.3 研究不足与扩展方向

附录：

【附录一】CSE均衡与博弈模型的识别(第4章 附录)

【附录二】顺序统计量与Perm算子(第6章 附录)

【附录三】程序附录

参考文献

后记

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>