

12月24日“双周论坛”探讨风险和一月效应

时间:2008-12-24 来源:财金学院 作者:财金学院 点击:

2008年12月24日,由汉青高级研究院、财政金融学院和梁晶工作室联合举办的“双周论坛”在明德主楼714成功举办。厦门大学财务管理与会计研究院财务学院院长孙谦教授就“风险和一月效应(RISK AND THE JANUARY EFFECT)”发表了精彩的演讲,汉青研究院、财政金融学院、经济学院、商学院部分老师和学生参加了此次学术活动。

孙谦教授先简单介绍了可以用时间序列广义自回归模型检验Rogalski and Tinic (1986)所提出的一月效应即该月份高风险的一种补偿现象的这种观点。然后说明并没有找到相关的证据表明一月份的条件波动或非条件波动高于历史同期样本的现状,所以一月效应并不是由于风险本身造成的。同时指出有证据表明一月效应是基于对该月风险的补偿,许多研究表明一月的波动比其他时间高,但仍可看出这种波动是有时间性的,且多出现于价值加权回归序列而不是无加权回归序列。

孙谦教授分别在北京大学、复旦大学、美国威利彼得森学院以及亚利桑那州立大学学习并获得经济学学士,工商管理硕士及经济学博士学位。曾在新加坡南洋理工大学任教,现为厦门大学财务管理与会计研究院财务学教授兼院长。

孙教授的研究领域主要集中在新兴市场,在国际学术期刊上发表了20篇论文,其中11篇被SSCI收录。他的研究成果主要涉及以下领域:民营化及公司财务,证券市场和投资和外国对华投资等。

报告会最后,与会老师、同学针对孙教授的发言进行了热烈讨论,提出了许多专业性、探索性的问题。

本期“双周论坛”为本学期最后一期。“双周论坛”作为汉青经济与金融高级研究院的科研平台之一已成功举办多期。每两周邀请国内外知名学者及青年学者,就最新研究成果和前沿问题进行主题讲演与学术讨论,搭建氛围轻松自由的学术交流平台,促进学术研究的创新与发展。

敬请关注下学期由汉青经济与金融高级研究院、财政金融学院、梁晶工作室联合举办的的上周论坛。



上一篇:“财金杯”校教工男子篮球赛我院二战告捷

下一篇:“财金杯”校男子篮球赛第三场我院不敌校体育部

新闻与事件

通知公告

财金新闻

讲座信息

专题报道