附件1：

项 目 征 集 表

|  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- |
| 教师姓名 | 朱光伟 | 职称 | 副教授 |
| 课题来源 | 国家自然科学基金  青年项目 | 课题名称 | 融资交易对股票市场定价效率的影响机制研究——基于微观个体行为的视角 |
| 课题编号 | 72003153 | 课题研究方向 | 金融市场、  投资者行为 |
| 课题简介 | 研究股票市场中个体融资交易者行为特征，进而研究融资机制对股票市场定价效率的影响 | | | |
| 拟设立国创项目题目 | 资本市场开放下的股市定价效率研究 | | | |
| 学生要求 | （对申报项目学生的科研素养及专业要求等）  大二到大四本科生，金融学相关专业优先。学生需具备基本的计量经济学知识，掌握stata的基本操作，踏实、勤奋，对科研具有浓厚兴趣。 | | | |
| 任务要求 | （拟设项目研究内容、实施过程及成效要求；1000字以内）   1. 研究内容   中国股票市场从2014年开始逐步启动了“沪港通”和“深港通”机制，开始进行双向开放改革。资本市场开放对金融系统和公司治理都会产生重要的影响。目前国内对此问题的研究刚刚起步，有大量值得深入研究的话题。本项目的主要研究内容包含两个部分：第一，资本市场开放对市场定价造成了怎样的影响；第二，资本市场开放影响定价的渠道分析，包括公司治理、信息治理、公司行为、投资者行为等方面。这些角度都是潜在的研究话题。   1. 实施过程   首先，学生需要大量阅读相关文献，定期和指导老师报告前人研究基础和前沿；第二，确定两到三个研究问题，有针对性地阅读文献；第三，根据研究问题确定研究思路和研究框架，并有针对性地深入学习计量方法，如双重差分、断点回归、PSM等；第四，正式开始实证研究，定期与指导老师交流进度，并完成论文撰写与投稿。   1. 成效要求   学生需通过本项目的研究，对我国资本市场开放的效果有深入的理解，形成2-3篇工作论文，并最终完成投稿与发表。 | | | |