



全国中文核心期刊
国家自然科学基金委员会管理科学部认定的管理科学A级重要期刊

ISSN 1007-9807
CN 12-1275/G3

管理科学学报

JOURNAL OF MANAGEMENT SCIENCES IN CHINA

2018

第 21 卷 (卷终) 第 12 期 Vol. 21 No. 12

ISSN 1007-9807



9 771007 980183

天津大学、国家自然科学基金委员会管理科学部

GUANLI KEXUE XUEBAO

目 次

· 论 文 ·

中欧货币汇率的极端风险传播研究 黄乃静, 汪寿阳(1)

控股股东股权质押影响上市公司“高送转”吗? 黄登仕, 黄禹舜, 周嘉南(18)

中国股票市场存在特质波动率之谜吗?

——基于分位数回归模型的实证分析 熊和平, 刘京军, 杨伊君, 等(37)

混合泊松违约强度下信用资产组合风险度量 陈荣达, 虞欢欢, 余乐安, 等(54)

暧昧与部分知情交易的资产定价 石丽娜, 张顺明(70)

社会责任强制披露下管理层机会主义行为考察

——基于 A 股上市公司的经验证据 权小锋, 徐星美, 许 荣(95)

中国地区间收入差异变化的影响因素探究

——基于国内价值链视角的分析 段玉婉, 纪 珽(111)

期刊基本参数: CN 12-1275/G3 * 1998 * m * A4 * 126 * zh * P * ¥32.00 * 2200 * 7 * 2018 - 12

JOURNAL OF MANAGEMENT SCIENCES IN CHINA

Vol. 21 No. 12 2018 (monthly)

CONTENTS

The extreme risk spillover between European currencies and Chinese Renminbi

..... *HUANG Nai-jing, WANG Shou-yang* (1)

Does controlling shareholder's share pledge affect the firm's decision on large stock dividends?

..... *HUANG Deng-shi, HUANG Yu-shun, ZHOU Jia-nan* (18)

Is there idiosyncratic volatility puzzle in Chinese stock markets: A quantile regression analysis

..... *XIONG He-ping, LIU Jing-jun, YANG Yi-jun, et al* (37)

Portfolio credit risk measurement based on mixed Poisson default intensity

..... *CHEN Rong-da, YU Huan-huan, YU Le-an, et al* (54)

Ambiguity and asset prices with incompletely informed trading

..... *SHI Li-na, ZHANG Shun-ming* (70)

Management opportunistic behavior in the compulsory disclosure of corporate social responsibility:

Empirical evidence based on A share listed companies

..... *QUAN Xiao-feng, XU Xing-mei, XU Rong* (95)

Dynamic of China's regional income disparity and its determinants: A domestic value chain perspective

..... *DUAN Yu-wan, JI Ting* (111)

《管理科学学报》(月刊, 1998年1月创刊) 2018年 第21卷(卷终) 第12期 总第174期

主管单位: 中华人民共和国教育部

主办单位: 天津大学、国家自然科学基金委员会管理科学部

主 编: 吴启迪

编辑出版: 《管理科学学报》编辑部

地 址: 天津市南开区卫津路92号 天津大学

邮政编码: 300072 电话: 022-27403197

印 刷: 天津市云海科贸开发公司

发 行: 天津邮政报刊发行局

订 购 处: 全国各地邮局

海外发行: 中国国际图书贸易总公司

邮发代号: 国内6-89
国外M5062

E-mail: jmsstju @ 263.net

网址: jmsc.tju.edu.cn

2018年12月出版 定价: 32元