

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 第 6 期 Vol. 21 No. 6

ISSN 1007-9807



天津大学、国家自然科学基金委员会管理科学部

GUANLI KEXUE XUEBAO

万方数据

目 次

· 论 文 ·

利差交易、异质预期与汇率微观决定 李小平, 吴冲锋(1)

金融危机期间汇率风险传染研究 万蕤叶, 陆 静(12)

基于协高阶矩视角的沪港股市风险传染分析 王 鹏, 吴金宴(29)

网络新媒体信息披露的经济后果研究

——基于股价同步性的视角 何贤杰, 王孝钰, 孙淑伟, 等(43)

投资者关注和股市表现——基于雪球关注度的研究 孙书娜, 孙 谦(60)

买卖价差限制对做市商报价影响的实验研究 王文虎, 万迪昉, 吴祖光(72)

经济政策不确定性与我国股市波动率预测研究 雷立坤, 余 江, 魏 宇, 等(88)

技术指标能够预测商品期货价格吗? 来自中国的证据 尹力博, 杨清元, 韩立岩(99)

国际化程度与绩效关系的中外企业差异

——来自 500 强企业的经验证据 范建亭, 刘 勇(110)

JOURNAL OF MANAGEMENT SCIENCES IN CHINA

Vol. 21 No. 6 2018 (monthly)

CONTENTS

Carry trade, heterogeneous expectation and micro exchange rate determination

..... *LI Xiao-ping, WU Chong-feng* (1)

Contagion of exchange rate risk during financial crises

..... *WAN Rui-ye, LU Jing* (12)

Risk contagion between Shanghai and Hong Kong stock market: A perspective of higher order

co-moments *WANG Peng, WU Jin-yan* (29)

Economic consequences of new media information disclosure: From the perspective of stock price

synchronicity *HE Xian-jie, WANG Xiao-yu, SUN Shu-wei, et al* (43)

Investor attention and market performance: Evidence based on “Xueqiu attention”

..... *SUN Shu-na, SUN Qian* (60)

Impact of different bid-ask spread limits on quotation of market makers: Evidence from a laboratory

experiment *WANG Wen-hu, WAN Di-fang, WU Zu-guang* (72)

Forecasting volatility of Chinese stock market with economic policy uncertainty

..... *LEI Li-kun, YU Jiang, WEI Yu, et al* (88)

Can technical indicators forecast commodity prices? Evidence from China

..... *YIN Li-bo, YANG Qing-yuan, HAN Li-yan* (99)

Comparison of the internationalization-performance relationships between Chinese 500 and Global 500

..... *FAN Jian-ting, LIU Yong* (110)

《管理科学学报》(月刊, 1998年1月创刊)

2018年 第 21 卷 第 6 期 总第 168 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: jmsztj@263.net

网址: jmsc.tju.edu.cn

2018年6月出版

定价: 32元