

中国证券业协会 2008 年度科研课题获奖成果和最佳组织奖名单

中国证券业协会 2008 年度科研课题候选获奖研究成果包括证券市场运行类 (A 类)、金融产品创新类 (B 类)、上市公司类 (C 类)、证券公司类 (D 类)、基金公司类 (E 类)、宏观环境类 (F 类)、投资者教育专项课题类 (G 类) 和证券公司核心竞争力类 (H 类), 共 8 类 62 项; 最佳组织奖 3 项。

一、证券市场运行类 (A 类, 共 8 项)

一等奖
文章标题: A 股系统性风险时变估计方法及实证研究
作者姓名: 刘景德、张捷
报送单位: 信达证券股份有限公司、中国社会科学院研究生院

二等奖
文章标题: A 股市场系统性风险的实证研究
作者姓名: 任少华、朱丹、郭静静、袁理、陈强、朱涵明
报送单位: 东吴证券有限责任公司
文章标题: 资本市场系统风险的评估、预警及控制研究
作者姓名: 闻岳春、黄福宁、石建勋、王婧婷、程同朦、朱卓家

报送单位: 浙商证券有限责任公司
三等奖
文章标题: 证券市场的资金流动研究
作者姓名: 朱华成、于栋华
报送单位: 光大证券股份有限公司
文章标题: 股指期货对现货的引导与预测
作者姓名: 蒋琰琨、何苗、杨洁
报送单位: 国泰君安证券股份有限公司
文章标题: A 股市场境外投机资本规模估算和进出途径研究

作者姓名: 崔秀红、伍志文、张仕元、王大力
报送单位: 西南证券有限责任公司、中国人民大学财政金融学院

文章标题: 基于行为金融学的股市牛熊转换因素实证分析
作者姓名: 陈明星、纪青、刘凌云、刘俊
报送单位: 中海基金管理有限公司
文章标题: 我国股市系统性风险分析
作者姓名: 王佩艳、胡新辉
报送单位: 华泰证券股份有限公司

二、金融产品创新类 (B 类, 共 8 项)

一等奖
文章标题: 场外交易市场发展路径研究
作者姓名: 刘喆、李学峰、张颀、常培斌
报送单位: 西南证券有限责任公司

二等奖
文章标题: 持股类上市公司定价技术研究
作者姓名: 范亭辛、邓二勇
报送单位: 长江证券股份有限公司
文章标题: 股指期货与现货联动操纵及反操纵研究
作者姓名: 马龙官、陈洪贵、赵立臣
报送单位: 申银万国证券股份有限公司

三等奖
文章标题: 基于非对称策略的绝对收益基金构建研究
作者姓名: 檀向球、赵立臣、范立强
报送单位: 申银万国证券股份有限公司
文章标题: 新会计准则下股票资产公允价值市值技术实证研究

作者姓名: 郝力平、王晓宇、林海股
报送单位: 航空证券有限责任公司
文章标题: 通货膨胀挂钩债券定价机理及初步设计探讨
作者姓名: 赵旭、韩健
报送单位: 东北证券股份有限公司
文章标题: 融资融券对证券公司收益与风险影响研究
作者姓名: 张伏波、林琳、陈志斌、姚立环
报送单位: 上海证券有限责任公司
文章标题: 股指期货推出对市场流动性及成份股的作用

机制研究
作者姓名: 李康、袁瑶、李诗白、江林鑫
报送单位: 光大证券股份有限公司、上海财经大学金融学院

三、上市公司类 (C 类, 共 8 项)

一等奖
文章标题: 境内外证券市场 IPO 制度比较研究
作者姓名: 姚兴涛、周凤、林琳、谢四平、李华铮
报送单位: 上海证券有限责任公司

二等奖
文章标题: 限售股解禁、大宗交易平台对股市的影响
作者姓名: 张建龙、张小涛、邢恩泉、邹超
报送单位: 西南证券有限责任公司
文章标题: 大小非解禁规模及其影响的实证研究
作者姓名: 范力、曹妍、徐磊磊
报送单位: 东吴证券有限责任公司

三等奖
文章标题: 外资并购我国上市公司的方式与动机演进及其对上市公司的影响研究
作者姓名: 尹华、冯正强、张灿、张蕾、朱庆子
报送单位: 中南大学
文章标题: 上市公司股权激励的实证研究——来自会计度量噪音角度的替代解释
作者姓名: 李蓉、于旭辉
报送单位: 上海申银万国证券研究所有限公司
文章标题: 上市公司及金融机构薪酬和激励约束机制研究

作者姓名: 司微、王玉亭、谢至超、温立华、卫进扬
报送单位: 招商证券股份有限公司
文章标题: 股改限售股解禁规模及其影响的实证分析
作者姓名: 詹诗华、代鹏举、李冬、马春霞
报送单位: 浙商证券有限责任公司
文章标题: 限售股解禁与减持: 市场反应、大股东行为及其监管
作者姓名: 汪辉、喻立勇、李路
报送单位: 海通证券股份有限公司、上海证券交易所、上海财经大学会计学院

四、证券公司类 (D 类, 共 8 项)

一等奖
文章标题: 新形势下保荐人管理制度研究
作者姓名: 张伟、王珂、孙霞、王思飞
报送单位: 世纪证券有限责任公司

二等奖
文章标题: 独立投行模式: 运作绩效、危机机理与发展路径选择
作者姓名: 陶鹏春、陈慧莹
报送单位: 国信证券股份有限公司
文章标题: 变革之后: 投资银行业务所涉法律关系的重构
作者姓名: 季社建
报送单位: 华泰证券股份有限公司

三等奖
文章标题: 我国证券经纪人制度建设研究
作者姓名: 陈卫中、张兴旭、王灿江
报送单位: 南京证券有限责任公司
文章标题: 上市公司信用评级体系研究
作者姓名: 张睿、屈庆、张磊
报送单位: 上海申银万国证券研究所有限公司
文章标题: 基于内外部环境改善的证券公司合规管理
作者姓名: 史明坤、康静、吴盛生、张伟明
报送单位: 太平洋证券股份有限公司
文章标题: 三方存管中单边账和透支问题的解决方案
作者姓名: 李凌、吴昊、丁丁、胡宁
报送单位: 华林证券有限责任公司
文章标题: 证券公司薪酬激励机制研究
作者姓名: 韩冰、刘雁、俞冲

报送单位: 世纪证券有限责任公司
五、基金公司类 (E 类, 共 8 项)

一等奖
文章标题: 开放式基金持有人赎回行为的实证研究
作者姓名: 解学成、李兆军、张龙斌、邹超
报送单位: 西南证券有限责任公司

二等奖
文章标题: 我国基金业绩持续性影响因素分析及长效评价体系构建
作者姓名: 郑德棋、王丽萍、李楠、赵巧敏、欧阳铭
报送单位: 广州证券有限责任公司、Dowling College
文章标题: 基金投资行为对股票市场稳定性影响实证研究

作者姓名: 俞雪飞、李琛、李建朋
报送单位: 信达证券股份有限公司
三等奖
文章标题: 股市震荡、基金行为与市场质量——基于沪市基金交易账户的经验证据
作者姓名: 张宗新、朱伟骅、沈正阳、吴娜
报送单位: 东北证券股份有限公司
文章标题: 基金业绩操纵及其对市场的影响
作者姓名: 史永东、李竹薇、甄红线、李凤羽、杨墨竹、朱广印

报送单位: 东北财经大学应用金融研究中心
文章标题: 开放式基金信息披露制度的国际比较
作者姓名: 赵秀娟、齐晓楠、汪寿阳
报送单位: 北京邮电大学经济管理学院、中国科学院研究生院管理学院、中国科学院数学与系统科学研究院
文章标题: 基金经理变动对开放式基金业绩的影响研究
作者姓名: 姚小军、苏昌景
报送单位: 国都证券有限责任公司
文章标题: 基金公司投资决策体系比较研究
作者姓名: 陆金海、余达胜、杨宏亮、葛俊杰
报送单位: 宝盈基金管理有限公司

六、宏观环境类 (F 类, 共 8 项)

一等奖
文章标题: 通货膨胀影响资本市场的实证研究
作者姓名: 诸建芳、孙稳存、孙小溪、刘可
报送单位: 中信证券股份有限公司

二等奖
文章标题: 我国股票市场传导货币政策的实证分析
作者姓名: 黄琳、罗标强、李秀玉、耿芙蓉
报送单位: 东吴证券有限责任公司
文章标题: 股票市场传导货币政策的实证分析与实验研究

作者姓名: 仲伟周、胡莹、金帆、王新红、李丹、赵媛
报送单位: 西安交通大学经济与金融学院
三等奖
文章标题: 次贷危机形成的根源和传导扩散机制研究
作者姓名: 张宪、王伟、刘振聚
报送单位: 航空证券有限责任公司
文章标题: 通货膨胀影响资本市场的实证研究
作者姓名: 黄常忠、卢婷、聂小丽、辛扬
报送单位: 民生证券有限责任公司
文章标题: 我国证券印花税法制度研究
作者姓名: 洪明、徐海洋、祖广平
报送单位: 日信证券有限责任公司
文章标题: 中国经济周期研究及应对当前周期调整的方案

作者姓名: 银国宏、谭松
报送单位: 东兴证券股份有限公司
文章标题: 通货膨胀影响资本市场的实证研究
作者姓名: 董先安、李世光、郭奔宇、殷韦

证券代码: 002119 证券简称: 康强电子 公告编号: 2009-017

宁波康强电子股份有限公司 关于刘俊良董事减持公司股份的公告

本公司及其董事、监事、高级管理人员保证公告内容真实、准确和完整, 并对公告中的虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏承担责任。

公司现任副董事长刘俊良先生为宁波康强电子股份有限公司(以下简称“公司”)发起人股东之一, 持有公司 16, 526, 320 股股份(发行上市前持有 8, 262, 660 股, 公司 2007 年年度利润分配及公积金转增股本方案实施后增加到 16, 526, 320 股), 占公司总股本的 8.51%, 该等股份已于 2008 年 3 月 2 日解除限售, 同时按照相关规定, 刘俊良先生减持每年减持股份的数量不超过其持股总量的 25%。

根据深圳证券交易所(以下简称“深交所”)于 2008 年 11 月 6 日发布的《上市公司董监高买卖本公司股份意向报备业务指引》的要求, 刘俊良先生于 2008 年 11 月 10 日通过公司董事会在深交所业务专区报备了其未来 6 个月的股票减持计划。自 2008 年 10 月 29 日至 2009 年 4 月 22 日收盘, 刘俊良先生累计减持公司股份 4, 429, 900 股, 占公司总股本的 2.26%, 累计交易金额为 19, 068, 806.15 元, 交割价格区间为 2.88-5.34 元, 仍持有公司股份 12, 096, 420 股, 占总股本的 62.2%。

减持明细具体如下:

减持日期	成交数量	成交价格	成交均价	留存股份数量
2008/10/29	77, 300	232, 821.00	3.01	16, 526, 320
2008/10/30	51, 500	154, 965.00	3.01	16, 396, 520
2008/10/31	22, 000	66, 000.00	3.00	16, 374, 520
2008/11/04	42, 500	121, 097.00	2.85	16, 332, 020
2008/11/05	40, 800	119, 424.12	2.92	16, 291, 134
2008/11/11	215, 700	679, 863.00	3.15	16, 075, 434
2008/11/12	484, 500	1, 564, 082.00	3.14	15, 590, 934
2008/11/13	688, 300	2, 223, 030.00	3.23	14, 912, 634
2008/11/14	285, 114	967, 862.04	3.38	14, 627, 520

刘俊良先生在股票减持过程中均为单向卖出, 不存在短线交易行为; 不存在利用内幕信息或敏感时间减持公司股份情形; 同时每月减持数量均未超过总股本 1%, 不存在违规减持、违规减持行为。

刘俊良先生减持公司股份部分原因是出于个人资金需要, 其主要意识上不存在故意隐瞒减持公司股份信息的情形, 但由于对相关规章制度学习认识不深, 未能能在 2 个工作日内及时通过公司董事会向深交所申报减持公司股份情况, 与《公司章程》、监事和高级管理人员所持本公司股份及其变动管理制度的相关规定不符。公司董事会责令其今后加强学习, 严格遵守相关规章制度, 坚决杜绝此类情况的发生。

2009 年 4 月 17 日, 刘俊良先生通过公司董事会向深交所申报了其减持公司股份的详细信息, 并已在深交所中小板诚信档案中进行了公开披露。

特此公告。

宁波康强电子股份有限公司 董事会
2009 年 4 月 24 日

证券代码: 600180 证券简称: *ST 九发 编号: 临 2009-024

山东九发食用菌股份有限公司 重大资产重组事项暨停牌公告

公司管理人保证公告内容的真实、准确、完整, 无虚假记载、误导性陈述或重大遗漏。

一、股票交易异常波动的具体情况

2009 年 4 月 20 日至 2009 年 4 月 22 日公司股票连续三个交易日内交易价格触及涨幅限制, 属于股票交易异常波动的情况。

二、管理人关注并核实的相关情况

经证询公司控股股东, 截止目前, 公司除《山东九发食用菌股份有限公司重大资产重组事项停牌公告》等已公告的信息外, 无其他应披露而未披露的事项。

三、是否存在应披露而未披露的重大信息的声明

管理人确认截止目前且在未本周内, 除已被披露的公开信息外, 本公司没有任何根据《上海证券交易所股票上市规则》等有关法定应予披露而未披露的事项或与该事项有关的筹划、商谈、意向、协议等, 管理人也未获悉本公司有根据《上海证券交易所股票上市规则》等有关法定应予披露而未披露的, 对本公司股票及其衍生品种交易价格产生较大影响的其他信息。

四、管理人认为必要的风险提示

公司指定的信息披露媒体为《上海证券报》、《中国证券报》及上海证券交易所网站(www.sse.com.cn)。公司管理人将及时披露相关信息, 提醒广大投资者注意投资风险。

特此公告

山东九发食用菌股份有限公司 管理人
2009 年 4 月 23 日

证券简称: 荣华实业 证券代码: 600311 公告编号: 2009-012

甘肃荣华实业(集团)股份有限公司 第四届董事会第四次临时会议决议公告

本公司及董事会全体成员保证公告内容的真实、准确和完整, 对公告的虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏承担责任。

甘肃荣华实业(集团)股份有限公司第四届董事会第四次临时会议于 2009 年 4 月 22 日以传真方式召开, 应到董事 11 名, 符合《公司法》和《公司章程》的要求, 会议由董事长张严德先生主持, 会议经审议表决, 通过了《关于肃北县浙商矿业投资有限公司建设年处理矿石 66 万吨选矿工程项目的议案》。

本公司自 2008 年 9 月完成了对浙商矿业 100% 股权的收购以来, 顺利实现了生产经营的交接转换, 根据公司 2009 年度资金使用计划, 公司拟建设年处理矿石 66 万吨(日处理 2000 吨)选矿工程项目, 将矿石处理能力由原来的年处理 26.4 万吨(日处理 800 吨)扩大到年处理 92.4 万吨(日处理 2900 吨), 做大做强黄金产业。

年处理矿石 66 万吨选矿工程项目总投资约为 1.5 亿, 根据目前黄金销售价格, 项目建成后年平均销售收入约为 4 亿元(含增值税)。本公司已委托兰州万利资源开发设计所对该项目编制《可行性研究报告》。

本公司将通过自筹或银行贷款的方式解决建设资金问题。第一大股东武威荣华工贸有限公司已出具承诺函, 同意通过提供担保、股权质押等方式协助本公司筹措资金, 也可以按照本公司的需求通过股东借款、代建、代购等方式提供不低于人民币 15000 万元的资金支持。

本公司授权浙商矿业办理项目建设所需的相关手续。

特此公告。

甘肃荣华实业(集团)股份有限公司 董事会
2009 年 4 月 22 日

证券代码: 600719 证券简称: 大连热电 公告编号: 临 2009-009

大连热电股份有限公司 股票交易异常波动公告

本公司董事会及全体董事保证本公告内容不存在任何虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏, 并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带责任。

重要提示:

一、公司股票交易最近连续三个交易日收盘价价格涨幅偏离值累计达 20%, 属于股票交易异常波动, 经向公司控股股东, 并经自查后认为: 除年报、季报披露信息外, 本公司无应披露而未披露的信息。

二、公司股票交易异常波动的具体情况

公司股票交易最近三个交易日 2009 年 4 月 21 日、22 日、23 日收盘价价格涨幅偏离值累计达 20%, 根据上海证券交易所《股票交易规则》的有关规定, 属于股票交易异常波动。

三、公司关注并核实的相关情况

公司此前曾向公司控股股东并自查后确认:

一、公司及公司的控股股东不存在应披露而未披露的重大信息, 包括但不限于公司股权转让、非公开发行、债务重组、业务重组、资产剥离、业绩承诺和资产注入等重大事项, 并承诺至少未来 3 个月内不会策划股权转让、非公开发行、债务重组、业务重组、资产剥离、资产注入等重大事项;

二、除年报、季报披露的信息外, 公司目前生产经营正常, 无影响公司股票交易价格异常波动的事项, 同时提请各位投资者注意的是: 公司属于纯电力类、集中供热企业, 生产销售和提供服务具有季节性特征。

三、是否存在应披露而未披露的重大信息的声明

本公司董事会确认, 本公司没有任何根据《上海证券交易所股票上市规则》等有关法定应予披露而未披露的事项。

四、公司认为必要的风险提示

本公司指定信息披露媒体为《上海证券报》、《中国证券报》为本公司指定的信息披露报刊, 本公司发布的信息以上述指定报刊以及上海证券交易所网站刊登的公告为准。公司将严格按照有关法律法规的规定和要求, 及时做好信息披露工作, 敬请广大投资者注意投资风险。

特此公告

大连热电股份有限公司
2009 年 4 月 23 日

股票代码: 000569 股票简称: 长城股份 公告编号: 2009-014

攀枝花新钢钒股份有限公司 关于换股吸收合并攀钢集团重庆钛业股份有限公司、攀钢集团四川长城特殊钢股份有限公司 停牌公告

本公司及董事会全体成员保证公告内容的真实、准确和完整, 对公告的虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏承担责任。

攀枝花新钢钒股份有限公司(以下简称“攀钢钒钒”)拟通过向攀枝花钢铁(集团)公司(以下简称“攀钢集团”)及其关联方发行股份购买资产, 同时换股吸收合并攀钢集团重庆钛业股份有限公司(以下简称“攀钢钛业”)和攀钢集团四川长城特殊钢股份有限公司(以下简称“长城股份”)的方式实施重大资产重组(以下简称“本次重组”)。

本次重大资产重组之首次现金选择权申报已于 2009 年 4 月 23 日结束, 根据《攀枝花新钢钒股份有限公司关于换股吸收合并攀钢集团重庆钛业股份有限公司、攀钢集团四川长城特殊钢股份有限公司现金选择权实施公告》的相关时间安排, 攀钢钒钒(000529)、攀钢钛业(000516)及长城股份(000569)三家上市公司股票将于 2009 年 4 月 24 日起停牌, 攀钢钒钒(000529)股票将在完成后续首次现金选择权过户及资金清算、第二次现金选择权派发及换股吸收合并并恢复交易。

特此公告。

攀钢集团四川长城特殊钢股份有限公司
2009 年 4 月 23 日