

<<资产定价研究>>

图书基本信息

书名：<<资产定价研究>>

13位ISBN编号：9787030208729

10位ISBN编号：7030208722

出版时间：2008-1

出版时间：科学

作者：吴冲锋

页数：241

版权说明：本站所提供下载的PDF图书仅提供预览和简介，请支持正版图书。

更多资源请访问：<http://www.tushu007.com>

## <<资产定价研究>>

### 内容概要

本书通过对资产定价问题进行系统的思考，建立了创新链—资产链—价值链—资产定价研究的新体系；在此基础上，本书第2～第4章分别提出了基于公司和市场结合的资本资产定价的静态模型、基于公司和市场结合的资本资产定价的动态模型，以及基于公司和市场结合的资本资产定价模型对“股利之谜”的解释；在第5～第8章中分别对上述理论模型进行实证研究，主要包括基于公司与市场结合的资本资产定价模型的实证研究、横截面定价异常现象研究、基础—衍生定价异常现象研究、混合定价异常现象研究。

本书适合作为从事金融研究的研究生、学者，以及从事金融行业的专业人才的参考书。

## &lt;&lt;资产定价研究&gt;&gt;

## 书籍目录

总序前言第1章 资产定价问题的思考 1.1 引言 1.2 资产变化链 1.3 资产链与资产定价理论 1.4 资产链与资本资产定价研究之异常现象 1.5 资产定价研究思想与理论回顾与评述 1.6 资产定价研究展望第2章 基于公司和市场结合的资本资产定价的静态模型 2.1 引言 2.2 基于公司和市场结合的资本资产定价模型的构建 2.3 考虑派发现金股利时的基于公司和市场结合的资本资产定价模型 2.4 考虑股利所得税时的基于公司和市场结合的资本资产定价模型 2.5 本章小结与展望第3章 基于公司和市场结合的资本资产定价的动态模型 3.1 引言 3.2 股价的一般动力学分析 3.3 基于公司与市场结合的股票价格动力学分析 3.4 股票价格动力学与静态模型的统一 3.5 本章小结第4章 基于公司和市场结合的资本资产定价模型对“股利之谜”的解释 4.1 引言 4.2 国内外对“股利之谜”的研究分析 4.3 基于公司和市场结合的资本资产定价模型对“股利之谜”的理论解释 4.4 现金股利率和市净率的横截面分析 4.5 现金股利率和市净率的时间序列分析 4.6 本章小结第5章 基于公司与市场结合的资本资产定价模型的实证研究 5.1 引言 5.2 资产定价模型的实证方法分析与选择 5.3 基于公司与市场结合的资本资产定价模型的实证检验 5.4 基于公司与市场结合的资本资产定价模型对个股的实证检验结论 5.5 基于公司与市场结合的资本资产定价模型对Fama—French组合的实证检验结论 5.6 基于公司与市场结合的资本资产定价模型对固定BM—SIZE组合的实证检验结论 5.7 基于公司与市场结合的资本资产定价模型对Q组合的实证检验结论 5.8 本章小结第6章 横截面定价异常现象研究 6.1 引言 6.2 CAPM截距项异常与无风险利率异常实证研究 6.3 资产收益的反转效应和动量效应的研究回顾 6.4 中国股市日度反转效应与反向利润研究 6.5 周度检验周期下中国股市动量效应与利润研究第7章 基础—衍生定价异常现象研究 7.1 引言 7.2 公司内在价值与股票价格差异的研究 7.3 我国可转换债券定价异常现象的研究 7.4 我国权证定价异常现象研究 7.5 封闭式基金折价的实证研究第8章 混合异常现象研究 8.1 引言 8.2 基于价格分解的股票市场：BM效应实证研究 8.3 基于价格分解的股票市场动量与反转效应研究参考文献

<<资产定价研究>>

版权说明

本站所提供下载的PDF图书仅提供预览和简介，请支持正版图书。

更多资源请访问:<http://www.tushu007.com>