

## <<证券资产的定价研究>>

### 图书基本信息

书名：<<证券资产的定价研究>>

13位ISBN编号：9787509602164

10位ISBN编号：7509602165

出版时间：2008-5

出版时间：经济管理出版社

作者：赵贞玉

页数：140

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>

## <<证券资产的定价研究>>

### 内容概要

本书为《当代中国中青年经济学家文库》之一，主要是对证券资产的定价研究，内容包括现代资本市场理论、弹簧振子理论——研究证券价格波动的新范式、弹簧振子理论的实证模型、中国股市日历效应的实证研究、弹簧振子理论实证研究等。

## <<证券资产的定价研究>>

### 作者简介

赵贞玉 1973年生，安徽省合肥市人，管理学博士，上海大学国际工商与管理学院副教授、硕士生导师。  
先后获得理学（数学）学士、经济学（会计学）硕士和企业管理（公司财务）博士学位。

主要研究领域：公司财务、证券投资，包括证券投资的理论研究和实证研究、公司并购的定价和决策、公司财务的理论研究等。

攻读博士学位期间提出研究资本市场的新范式——弹簧振子理论（Spring Oscillator Theory, SOT），通过对上海股市数据进行实证研究，表明弹簧振子理论比有效市场假说对证券价格波动的解释能力更强。

先后在《管理科学学报》、《中国管理科学》、《控制理论与应用》等学术期刊上发表论文十余篇。主持或参与纵向科研项目6项。

在资本市场理论与实践中有较深的理论功底和实践经验。

## <<证券资产的定价研究>>

### 书籍目录

第一章 绪论 一、研究的背景和意义 二、研究内容及其安排 三、全书创新点第二章 现代资本市场理论 一、资产选择理论 二、资本资产定价模型 三、套利定价理论 四、期权定价理论 五、有效市场假说 六、行为金融理论 七、混沌分形理论在资本市场中的运用 八、我国学者对资本市场理论的研究 九、本章小结 附录非系统风险的风险回报及其计量第三章 弹簧振子理论——研究证券价格波动的新范式 一、资本市场理论主要成果评点 二、弹簧振子理论 三、本章小结第四章 弹簧振子理论的实证模型 一、将弹簧振子理论模型的微分方程化为差分方程 二、根据实证模型的回归结果确定证券价格的波动方程 三、比较并检验资本市场定价效率和交易费用 四、实证的思路 五、样本数据 六、本章小结第五章 中国股市日历效应的实证研究 一、中国股市的周内“过度反应”实证研究 二、中国股市季节效应的实证研究 三、本章小结第六章 弹簧振子理论实证研究（一）——上海股市年报效应的实证研究 一、年报信息对价格水平影响的实证研究 二、年报信息对价格波动水平影响的实证研究 三、本章小结第七章 弹簧振子理论实证研究（二）——上海股市定价效率和交易费用的实证研究 一、实证的步骤 二、实证数据 三、对上海股市定价效率的实证检验 四、上海股市流通盘与交易成本、定价效率关系的实证研究 五、资本市场对年报数据的反应是否“理智”实证分析 六、本章小结第八章 全书总结和后续研究展望 一、本书的主要工作和结论 二、进一步研究的领域参考文献后记

<<证券资产的定价研究>>

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>