

<<数量金融经济学>>

图书基本信息

书名：<<数量金融经济学>>

13位ISBN编号：9787810888769

10位ISBN编号：7810888765

出版时间：2008-4

出版时间：西南财经大学出版社

作者：Cuthbertson

页数：497

译者：朱波

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>

## <<数量金融经济学>>

### 内容概要

本书内容覆盖了资产定价、投资决策和特殊策略分析的主要理论思想。主要内容包括金融中的基本概念、金融中的统计方法、有效市场假说及检验、资产收益的可预测性、线性因子模型及检验和应用、CCAPM和SDF、跨期资产配置理论与实证、期限结构理论与实证、金融异象与行为金融、外汇市场和微观结构理论等，内容丰富，难度适中。

本书可以用作金融学专业硕士研究生的数量分析教材，也是金融工程专业和数理金融专业硕士研究生的重要参考书，对金融数量分析感兴趣的高年级本科生和金融从业人员而言，本书也是非常有用的读物。

本书也可以用作金融经济学课程的辅助读物。

<<数量金融经济学>>

作者简介

朱波，1977年出生于四川省宣汉县，1995年考入西南师范大学数学系，1999年6月获理学学士学位，2002年6月获理学硕士学位，同年9月，考入中国社会科学院数量经济技术经济研究所，2005年6月获经济学博士学位。

现任职于西南财经大学金融学院，从事金融学的教学和科研工作，主授课程：连续时间金融、资产定价、实证金融、金融随机过程、金融工程、衍生金融工具。

研究方向：资产定价、实证金融、金融工程。

<<数量金融经济学>>

书籍目录

第1章 金融中的基本概念第2章 金融中的统计基础第3章 有效市场假说第4章 股票收益可预测吗  
第5章 均值方差组合论与资本资产定价模型第6章 分散化国际投资组合第7章 绩效度量、CAPM  
与APT第8章 CAPM和APT的经验证据第9章 线性因子模型的应用第10章 价值评估模型与资产收益  
第11章 股票价格的波动率第12章 股票价格：向量自回归方法第13章 SDF模型与CCAPM模型第14  
章 CCAPM模型：证据与扩展第15章 跨期资产配置：理论第16章 跨期资产配置：实证第17章 理  
性泡沫与学习第18章 行为金融与异像第19章 行为模型第20章 期限结构理论第21章 预期理论：  
从理论到实证第22章 期限结构的经验证据第23章 随机折现因子与衍射期限结构模型第24章 外汇  
市场第25章 检验CIP、UIP和FRU第26章 外汇风险溢价建模第27章 汇率与基本经济因素第28章  
市场风险第29章 波动率与市场微观结构参考文献推荐读物

## 章节摘录

第9章 线性因子模型的应用 数据 共同基金数据库由1596只单位信托基金和开放性投资公司(OEICs)组成。

单位信托基金将众多投资汇集在一起,使投资者分享充分分散化证券投资组合所带来的收益。

然而,根据信托契约的宗旨,单位信托基金的投资目标也常常不同。

从某种意义上说,单位信托基金是“开放式”共同基金,因为投资者随时都能以现行市场价格购买新的基金份额,对基金份额的需求不会使单位价格增加。

单位信托基金只能在投资者和信托经理之间进行交易,没有二级市场。

单位信托基金与投资信托基金有区别,后者常用术语“封闭式”基金来描述。

投资信托基金尽管也是将众多投资汇集在一起,它在股票交易所的报价是针对所有权而言的,也按照证券的方式进行交易。

与普通的股份公司一样,信托投资基金的份额数是固定的。

与单位信托基金不同的是,对投资信托基金的需求会提升每单位基金的价格。

因此,当价格高于(低于)资产的内在价值时,投资信托基金有可能进行溢价(折价)交易,溢价(比如说)有可能反映了投资者对投资信托基金经理投资技能的认同。

OEICs按照公司的形式进行组建,投资者可以购买它的股份,但发行的股份数会根据需求的变化而变化,所以人们用术语“开放式”来进行描述。

这意味着价格总是反映资产的内在价值,与投资信托基金不同的是,它的价格不受市场对OEICs情绪的影响。

因此,OEICs和单位信托基金的风险特征较投资信托基金更为明显。

<<数量金融经济学>>

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>