

## <<流动性溢价与资产定价>>

### 图书基本信息

书名：<<流动性溢价与资产定价>>

13位ISBN编号：9787811221152

10位ISBN编号：7811221152

出版时间：2007-6

出版时间：东北财大

作者：佟孟华

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>

## <<流动性溢价与资产定价>>

### 内容概要

流动性与资产定价是目前金融研究的热点之一。

本文通过检验交易频率零假设和交易成本备择假设，深入分析我国股市流动性与资产定价的理论及经验关系，发现：我国股市存在显著的流动性溢价，换手率低、交易成本高且流动性小的资产具有较高的预期收益；产生流动性溢价的原因是交易成本而不是交易频率；与国外股市相似，小企业收益率高于大企业，价值股收益率高于成长股。

因此，我国股市并非令人无法捉摸，流动性、规模和价值效应都是资产定价的因素。

<<流动性溢价与资产定价>>

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>