

<<资产定价的行为方法>>

图书基本信息

书名：<<资产定价的行为方法>>

13位ISBN编号：9787300081342

10位ISBN编号：7300081347

出版时间：2007-6

出版时间：中国人民大学出版社

作者：Hersh Shefrin

页数：514

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>

<<资产定价的行为方法>>

内容概要

《资产定价的行为方法》分析了传统资产定价理论中的经典假设，它重构了这些假设从而把行为金融的结果融入其中。

本书构造了一个严谨而且尚未有人研究的结构，这个结构对经典的金融学假设提出了挑战，同时提供了一个有力的理论和有效的实证工具。

根据传统资产定价的学者和行为资产定价学者构造的模型，本书做了更为深入的讨论。Shefrin对资产定价理论给出了一个一般性的、行为导向的时跨框架，这个框架可以加以拓展从而被用来对衍生产品、固定收入证券、均值方差有效组合和市场组合等进行讨论。

<<资产定价的行为方法>>

作者简介

Hersh Shefrin是加州圣塔克拉大学列维商学院的金融学Mario Belotti讲座教授。他是当前世界上从事行为金融研究的顶尖学者之一，在这个领域内，他发表了大量原创性的研究。

他的文章见诸于《金融学期刊》、《金融经济学期刊》、《金融研究评论》、《金融和数量分析期刊》

<<资产定价的行为方法>>

书籍目录

第1章 引言第一部分 直观推断和表征推断：实验证据 第2章 表征推断和贝叶斯法则：心理学视角 第3章 表征推断和贝叶斯法则：经济学视角 第4章 一个体现直观推断的简单资产定价模型 第5章 实验中的异质性判断第二部分 直观推断和表征推断：投资者预期 第6章 个人投资者、财务主管和学者的表征推断与异质性信念 第7章 职业投资者判断中的表征推断和异质性第三部分 构造行为资产定价模型 第8章 一个具有异质性信念的简单资产定价模型 第9章 异质性信念和无效市场 第10章 一个简单的价格和交易量市场模型 第11章 效率和熵：长期动态过程第四部分 风险承受和时间折现中的异质性 第12章 CRRA和CARA效用函数 第13章 异质性风险承受和时间偏好 第14章 在异质性CRRA模型中的代表投资者第五部分 情绪和行为随机折现因子 第15章 情绪 第16章 行为随机折现因子和情绪溢价第六部分 行为随机折现因子的应用 第17章 行为贝塔和均值方差证券组合 第18章 回报率期望的截面 第19章 情绪溢价的检验 第20章 利率期限结构的行为方法 第21章 行为Black-Scholes模型 第22章 非理性繁荣和期权笑型 第23章 支持行为随机折现因子的实证证据第七部分 前景理论第八部分 终篇参考文献索引译后记

<<资产定价的行为方法>>

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>