

<<现代金融学前沿问题研究>>

图书基本信息

书名：<<现代金融学前沿问题研究>>

13位ISBN编号：9787505854642

10位ISBN编号：750585464X

出版时间：2006-4

出版时间：经济科学出版社

作者：何基报

页数：147

字数：230000

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>

<<现代金融学前沿问题研究>>

内容概要

本书按照市场的信息和资源的对称程度、参与者的理性程度等，运用数学和数理统计工具，从市场为完全理性、部分理性、非理性三个层次，依次研究了完全理性、非完全理性和非理性市场中的资产价等相关问题。

由于笔者最近几年在深圳证券交易所从事市场监察的研究和实践工作，对中国股市的操纵行为有了深入了解，中国股市的操纵模式与国外学者所研究的操纵模式存在很大的差异。

以上模型代表了中国股市股价操纵行为的典型特征和行为过程，虽然近年来由于市场低迷，庄家有所减少，但股价操纵行的模式还是以该理论模型为基础，2000年以来出现的亿安科技、中科创业、德隆系以及最近的格林柯尔系等重大操纵案件都被包括在该理论模型之中。

非理性市场中的资产定价问题因为参与者非理性行为的多样性而变得复杂起来第四章的研究只是进入市场非理性领域研究的尝试性工作，目的是希望能引起这一类的研究。

相信关于市场的非理性行为的研究在将来会受到越来越多的人的重视。

<<现代金融学前沿问题研究>>

作者简介

何基报，1973年1月生，博士，高级经济师，副研究员。

2000年毕业于华东师范大学统计学系，获得学博士学位。

2000年8月到2002年5月，入中国人民大学博士后流动站、深圳证券交易所博士后工作站进行市场交易监管的博士后研究工作，成为深圳证券交易所博士后工作站每批博士后。

2002

<<现代金融学前沿问题研究>>

书籍目录

第一章 引言 1.1 现代证券组合理论与资本资产定价模型 1.2 资本资产定价模型研究进展 1.3 理性预期模型 1.4 本书主要工作概述第二章 完全理性市场情况下的资本资产价格模型——条件CAPM、非参数估计方法 2.1 条件CAPM 2.2 条件CAPM的参数、非参数估计方法 2.3 三种基于CAPM的量优投资组合构造方案及其比较 2.4 时变 条件CAPM中的 系数函数非参数估计的渐近性质 2.5 $m(v, v_m)$, (v, v_m) 函数估计的渐近偏差和渐近方差第三章 非安全理性市场情况下的资产价格模型——非对称信息场合下的理性预期平衡价格模型 3.0 引言 3.2 基本假定及引理 3.3 n 人的平衡价格模型 3.4 n 的的平衡价格模型的性质及其在金融研究中的意义 3.5 价格生成模型及参数估计 3.6 完全竞争情况下的多个资产的平衡价格模型 3.7 结论以及进一步研究的问题第四章 非理性市场中的资产价格形成和投资行为研究——庄家操纵股票价格模型 4.1 引言以及基本假定 4.2 以价格模型作为预测模型时的最优操纵战略 4.3 以收益率模型作为预测模型时的最优操纵战略参考文献

<<现代金融学前沿问题研究>>

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>