

图书基本信息

书名：<<基于PBF合同的代理投资与资产定价研究>>

13位ISBN编号：9787030362070

10位ISBN编号：7030362071

出版时间：2012-12

出版时间：科学出版社

作者：盛积良

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>

内容概要

投资主体机构化，代理问题日益突出，激励薪酬政策导致机构投资者为追求业绩而转嫁风险，2007~2008年金融危机爆发后，代理投资与金融风险、资产泡沫的关系成为国际学术界研究的热点之一。盛积良编写的这本《基于PBF合同的代理投资与资产定价研究》系统研究了基于PBF合同的代理投资及其对资产价格的影响。

具体内容包括：总风险约束和VaR约束对PBF合同激励的影响，并探讨其风险约束机制；机构投资者具有市场能力时PBF合同的激励与最优合同设计；管理者的信息成本与基准组合对PBF合同设计的影响；显性激励和隐性激励对基金风险承担行为的影响；资金流动不对称和PBF合同不对称对基金风险承担行为的影响；基金投资业绩与风险的关系；PBF合同下机构投资者的交易策略与资产价格的关系。

《基于PBF合同的代理投资与资产定价研究》可供金融工程学、应用数学、金融学、数量经济学、管理科学与工程等专业的研究人员及高等院校师生阅读参考，也可作为金融管理、机构投资等方面的从业工作者的参考书。

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>