

## <<行为资产定价理论>>

### 图书基本信息

书名：<<行为资产定价理论>>

13位ISBN编号：9787300072135

10位ISBN编号：7300072135

出版时间：2006-4

出版时间：中国人民大学出版社

作者：陈彦斌

页数：433

字数：339000

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>

## <<行为资产定价理论>>

### 内容概要

资产定价理论在金融学中处于核心地位。

资产定价理论的研究内容主要有两个方面：投资者如何将财富在各种风险资产之间进行最优分配；投资者如何确定资产市场中各种风险资产的均衡价格。

对这两个问题的回答一般称为投资组合理论和资产定价理论。

由于投资组合和资产定价是相互紧密联系的，所以一般也统称为资产定价理论。

自从马可维茨于1952年提出均值 - 方差资产组合选择模型以来，资产定价理论获得了巨大的发展，产生了并且继续在产生层出不穷、浩如烟海的模型。

这些模型不但丰富了资产定价理论，也对经济学的其他分支产生了巨大的影响和促进作用。

因此，如何认识这些模型背后的发展规律，并把握资产定价理论未来发展的动向是非常有意义的。

投资者参与资产市场的过程中，投资者的行为和资产市场的风险是互动的和相互影响的。

资产定价理论的发展是对投资者行为和风险的认识不断深入的过程。

本著作试图从投资者行为和风险的角度理解资产定价理论五十多年来的发展。

## <<行为资产定价理论>>

### 作者简介

陈彦斌，1976年9月出生于湖南省益阳市。  
1997年7月毕业于武汉大学计算机科学系，获学士学位；2000年7月毕业于武汉大学商学院，获硕士学位；2003年7月毕业于武汉大学商学院，获博士学位。  
2003年7月到中国人民大学经济学院任教，现任经济学 - 数学（双学位）实验班项目主任。

## <<行为资产定价理论>>

### 书籍目录

绪论 第1节 投资者行为和风险 第2节 资产组合理论 第3节 传统资产定价理论 第4节 行为资产定价理论  
第一编 连续时间模型 第1章 最优消费——资产组合选择模型 第1节 假定 第2节 最优解的存在性与唯一性 第3节 求解最优解：最优消费和资产组合规则 第4节 最优解的简化之一：引入无风险资产 第5节 最优解的简化之二：几何布朗运动 第6节 结论 第2章 资本资产定价模型 第1节 两基金分离定理 第2节 市场组合 第3节 资本资产定价模型 第3章 消费资本资产定价模型 第1节 基于风险基金的资本资产定价模型 第2节 消费资本资产定价模型 第4章 CRRA效用函数下的显示解 第1节 显示性最优解 第2节 最优解的一些性质  
第二编 离散时间模型 第5章 局部均衡资产定价模型 第1节 局部均衡模型 第2节 欧拉方程在经济学中的一些应用 第3节 使用欧拉方程导出传统资产定价模型 第6章 卢卡斯一般均衡资产定价模型 第1节 卢卡斯一般均衡模型 第2节 卢卡斯模型的递归求解 第3节 Mehra and Prescott模型：马氏链求解方法 .....  
第三编 行为资产定价 第四编 行为资产定价在中国宏观经济中的应用 参考文献

<<行为资产定价理论>>

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>