

图书基本信息

书名：<<现代证券金融理论前沿与中国实证>>

13位ISBN编号：9787313035721

10位ISBN编号：7313035721

出版时间：2004-9

出版时间：上海交通大学出版社

作者：杨朝军

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

全书采用理论与实证相结合的方法对现代证券金融理论中以下四个领域的问题进行了研究：资本资产定价、有效市场假设、组合投资管理评价和股票市场的流动性。

全书共分九章。

在第1章对股票收益率正态分布的检验方法进行了理论探讨和实证研究后,第2章详细介绍了资本资产定价模型(CAPM)的理论发展脉络,并以上海股票市场为样本,研究了收益与风险之间的关系。

第3章深入地探讨了市场效率的各种形式及其数量表达方法。

第4章探讨了以行为金融为代表的非理性金融理论,引入了信息过度反应及反应不足的数量研究方法。

第5章至第7章集中研究了以证券投资基金为代表的组合投资管理评价方法。

由于交易制度的差异,中外股票市场的股价形成机制不一样,本书第8章和第9章的研究表明,在采用限价指令的交易所中,上海股票市场的流动性处于领先水平,同时买卖价差达到最小报价单位的频率与其价格水平高度负相关：交易开始后市场深度有一个逐渐增加的过程,同时在接近交易结束时市场深度开始逐渐下降。

全书以整个现代证券金融投资理论体系为线索,其中既有西方理论研究前沿,也有作者在研究中国资本市场过程中在国内率先提出的模型,可供金融领域的理论工作者、博士研究生、硕士研究生以及高级证券分析师等人员参考。

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>