

# 《亚太地区股票市场的投资策略》

## 图书基本信息

书名：《亚太地区股票市场的投资策略》

13位ISBN编号：9787505814325

10位ISBN编号：750581432X

出版时间：1998-06

出版社：经济科学出版社

作者：张仁良,等

页数：172

版权说明：本站所提供下载的PDF图书仅提供预览和简介以及在线试读，请支持正版图书。

更多资源请访问：[www.tushu000.com](http://www.tushu000.com)

## 作者简介

### 作者简介

张仁良教授，获香港中文大学荣誉理学学士学位，法国巴黎第六大学（University of Paris VI）统计学博士学位，英国斯特拉斯克莱德大学（University of Strathclyde）财务学博士学位。曾就职于香港和欧洲教育与研究界，担任过香港消费者委员会有关银行业调查的项目协调人，香港联交所股票期权培训课程的统筹人，曾应邀赴英国斯特拉斯克莱德大学（University of Strathclyde）和东京青山学院大学（Aoyama Gakuin University）访问、讲学。现任香港城市大学商学院经济与金融学系系主任、讲座教授。近年来在国际知名学术刊物上先后发表学术论文逾三十篇。

胡斌博士，上海交通大学管理学院金融管理工程博士。1995年至1997年在香港城市大学经济与金融学系从事亚太地区股票市场分析与研究。现在美国伊利诺斯大学（University of Illinois at Urbana - Champaign）商学院深造。

## 书籍目录

### 目录

#### 引论

一 发展中国家或地区股票市场的作用

二 本书研究的目标及方法

三 本书的结构

#### 第一部分 理论基础

##### 第一章 投资组合理论与市场效率理论

###### 第一节 收益与风险

一 收益的测量

二 风险的测量

三 收益与风险的关系

###### 第二节 Markowitz的投资组合风险分散理论

###### 第三节 资本资产定价 (CAPM) 模型

一 模型的前提

二 市场组合的有效性

三 CAPM模型的导出

四 CAPM模型的含义

五 CAPM模型的实证分析

###### 第四节 资本市场效率理论

一 弱式效率市场

二 半强式效率市场

三 强式效率市场

#### 第二部分 市场背景

##### 第二章 亚洲股票市场简介

###### 第一节 日本股票市场

一 历史沿革

二 市场股价指数

三 对境外投资者的限制与开放

四 市场统计

###### 第二节 香港股票市场

一 历史沿革

二 市场股价指数

三 对境外投资者开放情况

四 市场统计

###### 第三节 台湾股票市场

一 历史沿革

二 市场股价指数

三 对境外投资者的限制与开放

四 市场统计

###### 第四节 韩国股票市场

一 历史沿革

二 市场股价指数

三 对境外投资者的开放与限制

四 市场统计

###### 第五节 马来西亚股票市场

一 历史沿革

二 市场股价指数

- 三 对境外投资者的限制与开放
- 四 市场统计
- 第六节 泰国股票市场
  - 一 历史沿革
  - 二 市场股价指数
  - 三 对境外投资者的限制与开放
  - 四 市场统计
- 第三章 亚洲股票市场综合对比
  - 第一节 股票市场容量与交易所的形式
  - 第二节 股票价格指数
    - 一 简单算术平均股价指数
    - 二 加权股价指数
    - 三 股票价格指数修正
  - 第四节 股票市场交易方式 清算 交割体系自动化
  - 第五节 股票市场的限制与开放
  - 第六节 交易时间
- 第三部分 实证分析
- 第四章 亚洲股票市场的分散投资
  - 第一节 引论
  - 第二节 数据来源和研究方法
  - 第三节 实证分析
    - 一 亚洲新兴股市与发达国家股市投资收益对比
    - 二 亚洲新兴股市与发达股市的相关分析
    - 三 相关系数矩阵的稳定性
  - 第四节 结论
- 第五章 亚洲股票市场的星期效应
  - 第一节 引论
  - 第二节 数据来源及研究方法
  - 第三节 实证分析
    - 一 投资收益的星期效应特征
    - 二 投资风险的星期效应特征
    - 三 一周内投资收益与风险的关系
  - 四 亚洲股市的“Rogalski”现象分析
  - 第四节 亚洲股票市场星期效应的解释
    - 一 投资收益星期效应的解释
    - 二 信息流因素对股市风险星期效应的解释
  - 第五节 结论
- 第六章 亚洲股票市场的小盘股效应及月份效应
  - 第一节 引论
  - 第二节 数据来源及研究方法
  - 第三节 实证分析
    - 一 小盘股效应分析
    - 二 元月效应分析
    - 三 大小盘股元月效应对比分析
  - 第四节 元月效应的解释
  - 第五节 结论
- 第七章 亚洲股票市场价格回归效应
  - 第一节 引论
  - 第二节 数据来源与研究方法

# 《亚太地区股票市场的投资策略》

- 一 数据来源
- 二 形成投资组合
- 三 持有期的选定
- 四 价格回归效应假设
- 五 价格回归投资策略收益检验
- 六 大小盘股的价格回归效应对比
- 第三节 实证分析
  - 一 日本
  - 二 香港
  - 三 台湾
  - 四 韩国
  - 五 马来西亚
  - 六 泰国
  - 七 亚洲各股市价格回归投资策略收益综合对比
  - 八 亚洲各股市大小盘股价格回归策略收益综合对比
- 第四节 结论
- 参考文献

# 《亚太地区股票市场的投资策略》

## 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:[www.tushu000.com](http://www.tushu000.com)