

# 《现代资产组合理论与资本市场均衡》

## 图书基本信息

书名：《现代资产组合理论与资本市场均衡模型》

13位ISBN编号：9787505813175

10位ISBN编号：750581317X

出版时间：1998-03

出版社：经济科学出版社

作者：刘志强

页数：168

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

刘志强 1965年

2月生于湖北，1994年

获经济学博士学位。曾在大学任教，讲授经济计量学、经济预测和决策等课程；后在君安证券有限责任公司研究所从事证券研究工作，在大鹏证券有限责任公司从事证券自营和总裁业务秘书工作。现为中国社会科学院世界经济与政治研究所博士后研究人员。已在国内经济学核心期刊发表论文十余篇。

## 书籍目录

目录

导言

上篇 现代资产组合理论

第1章 组合资产的收益、风险与有效边界的形状

1.1 收益、风险与投资决策

1.2 组合资产的收益率和风险的计算

1.3 有效边界的形状

第2章 有效边界的确定方法

2.1 借助存在无风险资产导出有效边界的方法

2.2 用规划法确定有效边界

第3章 资产收益的相关结构与效用分析

3.1 单指数模型

3.2 中国股市的一些相关性分析

3.3 多因素模型和总平均模型

3.4 效用分析

第4章 确定有效边界的简化技术及其灵敏度分析

4.1 单指数模型下的简化技术及其灵敏度分析

4.2 总平均模型下的简化技术及其灵敏度分析

下篇 资本市场均衡模型

第5章 标准CAPM及其应用

5.1 资本市场线

5.2 标准CAPM

5.3 利用标准CAPM修正资产组合的优化模型

5.4 标准CAPM的应用

第6章 非标准状态下的CAPM

6.1 违反允许卖空、无交易费用、资产无限可分、存在无风险资产假定时的CAPM

6.2 存在个人所得税时的CAPM

6.3 存在非适销资产、价格影响者时的CAPM

6.4 投资者预期不一致时的CAPM和在多个持有期下的CAPM

6.5 存在不确定的通货膨胀时的CAPM

第7章 CAPM的经验检验

7.1 事前预期和事后检验

7.2 CAPM的经验检验

7.3 对CAPM的传统检验的评论

第8章 套利定价理论

8.1 套利定价理论概述

8.2 套利定价模型的参数估计

第9章 APT的经验检验

9.1 经验检验的假定与方法

9.2 经验检验的实例

结束语 试析现代资产组合理论应用中存在的一些问题及解决办法

参考文献

# 《现代资产组合理论与资本市场均骸

## 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)