

《资产定价的行为方法》

图书基本信息

书名：《资产定价的行为方法》

13位ISBN编号：9787300081342

10位ISBN编号：7300081347

出版时间：2007-6

出版社：中国人民大学出版社

作者：Hersh Shefrin

页数：514

译者：王闻

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.tushu111.com

《资产定价的行为方法》

内容概要

《资产定价的行为方法》是关于研究“资产定价的行为方法”的专著，具体包括了：针对贝叶斯法则的含义、一个体现直观推断的简单资产定价模型、异质性信念和无效市场、在异质性CRRA模型中的代表投资者、行为随机折现因子和情绪溢价、行为贝塔和均值方差证券组合等方面的内容。

《资产定价的行为方法》

作者简介

Hersh Shefrin是加州圣塔克拉大学列维商学院的金融学Mario Belotti讲座教授。他是当前世界上从事行为金融研究的顶尖学者之一，在这个领域内，他发表了大量原创性的研究。他的文章见诸于《金融学期刊》、《金融经济学期刊》、《金融研究评论》、《金融和数量分析期刊》、《金融管理》、《金融分析师期刊》、《证券组合管理期刊》等全球著名的学术性和实务性金融杂志。

除了《资产定价的行为方法》一书之外，Shefrin教授还在1999年出版了面向实务界的《超越恐惧和贪婪》一书。

《资产定价的行为方法》

书籍目录

第1章 引言

1.1 为什么要阅读本书？

1.2 组织架构：本书的思想如何结成一体

1.3 小结

第一部分 直观推断和表征推断：实验证据

第2章 表征推断和贝叶斯法则：心理学视角

2.1 解释表征推断

2.2 针对贝叶斯法则的含义

2.3 实验

2.4 表征推断和预测

2.5 小结

第3章 表征推断和贝叶斯法则：经济学视角

第4章 一个体现直观推断的简单资产定价模型

第5章 实验中的异质性判断

第二部分 直观推断和表征推断：投资者预期

第6章 个人投资者、财务主管和学者的表征推断与异质性信念

第7章 职业投资者判断中的表征推断和异质性

第三部分 构造行为资产定价模型

第8章 一个具有异质性信念的简单资产定价模型

第9章 异质性信念和无效市场

第10章 一个简单的价格和交易量市场模型

第11章 效率和熵：长期动态过程

第四部分 风险承受和时间折现中的异质性

第12章 CRRA和CARA效用函数

第13章 异质性风险承受和时间偏好

第14章 在异质性CRRA模型中的代表投资者

第五部分 情绪和行为随机折现因子

第15章 情绪

第16章 行为随机折现因子和情绪溢价

第六部分 行为随机折现因子的应用

第17章 行为贝塔和均值方差证券组合

第18章 回报率期望的截面

第19章 情绪溢价的检验

第20章 利率期限结构的行为方法

第21章 行为Black-Scholes模型

第22章 非理性繁荣和期权笑型

第23章 支持行为随机折现因子的实证证据

第七部分 前景理论

第八部分 终篇

参考文献

索引

译后记

《资产定价的行为方法》

精彩短评

- 1、组合多元化讲的还是比较清楚的，实验略少？当成科普读物不错了……（可以拿来当教材第12~13章来看，Ross的中文译本太生硬了，英文版本不好啃……）
- 2、好书！这本书是我目前看到对行为金融学总结较深刻的一本，与其他书籍偏向讲实验讲结果不同，梳理定价模型的过程反映了对人性的洞见与对金融的了解。

《资产定价的行为方法》

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.tushu111.com