

学术研究

- 出版刊物
-
- 讲座与Seminar
-
- 工作论文
-
- 研究动态
-
- 科研成果
-

异质投资者与资产定价

发布时间： 2006-3-29 16:08:36 被浏览数： 777 次 来源： [欢迎访问武汉大学金融研究中心](#)

文字 [大 中 小]  自动滚屏 (右键暂停)

■ 篇 名	异质投资者与资产定价	■ 内容简介
■ 作 者	熊和平	<p>传统的资产定价理论通常假定所有的投资者具有同质的特性，即所有投资者在个人禀赋、偏好、信念等方面是相同的。这种同质的特性使得资产定价可以由简单的代表性投资者来代替整个经济系统，从而考虑的是代表性投资者的定价问题。这种代表性投资者的定价模型具有简单易于求解和易于实证检验的特性，但同时又遭到了实证结果的强有力的挑战。大量的金融“未解之谜”迫使经济学家们对传统的定价理论进行反思，并对其改进。异质投资者的定价问题是其中的重要方法之一。本文试图对该领域的研究进行综述，其重点是异质投资者定价问题的理论研究和一些主要的异质投资者的定价模型。</p>
■ 时 间	2006.1.20	
■ 关 键 字	异质投资者；同质投资者；资产定价；代表性投资者；行为金融；完全市场	
■ 联系方式		
■ 阅 读	点击下载	
>>关闭本窗口<<		

论文下载
(点击鼠标右键下载)

上两条同类新闻:

- 消费习惯、异质偏好与资产定价
- 超额货币与人民币汇率(江春教授)

 推荐给朋友 |  打包发回信箱 |  打印本页 |  关闭窗口

办公地址：武汉大学经济与管理学院大楼A518室

鄂ICP备05028596号