

## 不完备金融资产市场中的资本资产定价原理

王志华, 朱江

1. 山东经济学院财政金融系, 济南, 250014
2. 徐州师范大学数学系, 徐州, 221000

## Capital Asset Pricing Model In Incomplete Financial Asset Markets

Wang Zhihua, Zhu Jiang

1. Department of Finance, Shandong Economics Institute;
2. Department of Mathematics, Xuzhou Teachers' University

- [摘要](#)
- [参考文献](#)
- [相关文章](#)

Download: [PDF \(KB\)](#) [HTML \(KB\)](#) Export: [BibTeX](#) or [EndNote \(RIS\)](#) [Supporting Info](#)

**摘要** 本文中,我们在不完备金融资产市场的框架下研究了资本资产的定价问题,得到了著名的资本资产定价模型(CAPM)的一个重要推广形式,建立了相应的混合投资基金定理,这些结果对于金融资产市场的理论研究具有重要的意义。

**关键词:** [金融资产](#) [不完备市场](#) [均衡](#) [资本资产定价模型](#) [投资基金定理](#)

**Abstract:** In this paper, we consider capital asset pricing model in a framework of incomplete asset markets, an extension of CAPM and a mutel-fund theorem are proved.

收稿日期: 1996-11-21;

引用本文:

王志华, 朱江. 不完备金融资产市场中的资本资产定价原理[J] 中国管理科学, 1997,V(1): 52-56

### Service

[把本文推荐给朋友](#)

[加入我的书架](#)

[加入引用管理器](#)

[Email Alert](#)

[RSS](#)

### 作者相关文章

[王志华](#)

[朱江](#)

没有本文参考文献

没有找到本文相关文章