

---

## 第 6 单元 金融资产与价格

### 文献目录

- [1] Harry Markowitz, Portfolio Selection, The Journal of Finance , Vol. 7, No. 1. (Mar. 1952), pp. 77-91
- [2] Robert E. Lucas, Jr , Asset Price in an Exchange Economy , Econometrica, Vol. 46, No. 6. (Nov, 1978), pp. 1429-1445
- [3] Fama, E. Market Efficiency, Long-Term Returns, and Behavioral Finance . Journal of Financial Economics, 1998, 49 :283-306
- [4] 陈小悦, CAPM 在中国股市的有效性检验, 北京大学学报, 2000. 4
- [5] 张屹山, 对股票发行定价问题的探讨, 财贸经济, 1999. 12
- [6] 杨大勇, 金融经济学股票定价理论最新进展, 经济学动态, 2001. 4
- [7] 浙大经济学院, 论 CAPM 在我国股市中的应用, 财贸经济, 2001. 10
- [8] 侯永健, 论超强有效市场, 财贸经济, 2004. 12
- [9] 张谊浩, 人民币升值、股价上涨和热钱流入关系的实证研究, 金融研究, 2008. 11
- [10] 吕江林, 人民币升值对中国股市影响的实证分析, 金融研究, 2007. 6
- [11] 张晓朴, 系统性金融风险研究: 演进、成因与监管, 国际金融研究, 2010. 7
- [12] 郑振龙, 信息风险与资产定价研究述评, 经济学动态, 2009. 7
- [13] 靳云汇, 中国股票市场 CAPM 的实证研究, 金融研究, 2001. 7
- [14] 丁志国, 有效市场理论的思考——兼论传统金融学与行为金融学的分歧, 经济学动态, 2005. 5
- [15] 刘霖, 中国股票市场套利定价模型研究, 金融研究, 2004. 6
- [16] 刘少波, 资本市场有限套利及其均衡问题, 经济学动态, 2005. 9
- [17] 余斌, 资本资产定价模型遗留问题的探讨[J], 经济学家, 2009 (12)
- [18] 陈浪南, 资本资产定价模型的实证研究, 经济研究, 2000. 4