

<<时间、不确定性与资产定价>>

图书基本信息

书名：<<时间、不确定性与资产定价>>

13位ISBN编号：9787030190536

10位ISBN编号：703019053X

出版时间：2007-6

出版时间：科学出版社

作者：张岭松

页数：178

字数：218000

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：<http://www.tushu007.com>

## <<时间、不确定性与资产定价>>

### 内容概要

本书以时间、不确定性与资产定价作为主要研究内容，由三个部分组成：第一部分包括第一章和第二章，主要研究时间，分析确定性下的跨时期消费、投资行为与固定收益证券定价；第二部分包括第三章至第七章，主要研究不确定性，并分析投资者行为；第三部分包括第八章至第十一章，主要研究资产定价。

本书可供高等院校金融学专业科研人员、研究生和高年级本科生以及高级金融从业人员研究参考。

## <<时间、不确定性与资产定价>>

### 书籍目录

前言第一章 确定性下的跨时期消费与投资 1.1 偏好与效用 1.2 消费决策 1.3 跨时期选择  
1.4 Fisher分离定理第二章 固定收益证券定价 2.1 固定收益证券内涵 2.2 固定收益证券定价  
原理 2.3 利率期限结构第三章 不确定性下的期望效用理论 3.1 偏好与效用 3.2 期望效用理  
论第四章 风险厌恶 4.1 风险厌恶内涵 4.2 风险厌恶度量 4.3 常用效用函数第五 随机占优  
5.1 一阶随机占优 5.2 二阶随机占优第六章 资产组合 6.1 资产组合与风险报酬 6.2 资产  
组合与风险厌恶性质 6.3 两项基金货币分离第七章 均值-方差分析 7.1 理论基础 7.2 前沿证  
券组合 7.3 零协方差证券组合 7.4 引入无风险资产的前沿证券组合第八章 资本资产定价模型  
8.1 零贝塔CAPM 8.2 引入无风险资产的CAPM 8.3 两项基金分离与CAPM第九章 套利定价  
理论 9.1 因子模型 9.2 精确因子模型与APT 9.3 渐近无套利与APT 9.4 误差估计与均衡APT  
第十章 离散时间资产定价：两期模型 10.1 阿罗-德布鲁证券 10.2 普通证券市场 10.3 消费资  
本资产定价模型 10.4 无套利定价第十一章 离散时期资产定价：多期模型 11.1 完全市场竞争均  
衡 11.2 不完全市场竞争均衡 11.3 多期消费资本资产定价模型 11.4 多期五套利定价主要参考  
文献

<<时间、不确定性与资产定价>>

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:<http://www.tushu007.com>