

<<金融经济学教程>>

图书基本信息

书名：<<金融经济学教程>>

13位ISBN编号：9787302243175

10位ISBN编号：7302243174

出版时间：2010-12

出版时间：清华大学

作者：陈利平

页数：154

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>

<<金融经济学教程>>

内容概要

本教材是一门金融理论的高级教程，内容主要涉及投资组合理论、均衡资产定价理论、套利定价理论和行为金融学的一些基础知识。

对象为大学高年级本科生、硕(博)士研究生和相关专业的研究工作者。

学习本教材所需的基础知识是动态优化、动态规划、数学分析、概率论、高级宏微观经济学等。

本教材是作者在上海财经大学金融学院为研究生讲授金融经济学课程的讲稿基础上，参阅了许多国内外优秀教材，并结合学生的特点改写而成。

本教材的写作目的是为了提高学生的金融经济学基础知识，使学生对风险回避概念、风险与收益的折中关系、风险的分散化和风险的定价有一个较清晰的了解，并能利用这些基础知识更好地学习公司金融、金融工程、风险管理等其他专业课。

<<金融经济学教程>>

书籍目录

前言 第一章 基本概念 1.1 偏好的期望效用表示 1.1.1 不确定条件下的选择问题 1.1.2 期望效用函数的存在性 1.1.3 对理性选择的偏离：四个悖论 1.2 风险回避及其度量 1.2.1 风险回避 1.2.2 风险回避的度量 1.2.3 几种常见的效用函数 1.2.4 静态最优投资决策与比较静态分析 1.3 资产的随机占优 1.3.1 一阶随机占优 1.3.2 二阶随机占优 1.3.3 二阶随机单调占优和三阶随机占优 1.3.4 最优投资决策和比较静态分析 习题 第二章 投资组合理论 2.1 均值—方差模型的普适性 2.2 完全风险资产下的投资组合前沿 2.2.1 模型的建立 2.2.2 模型的求解 2.2.3 风险资产组合前沿的一些性质 2.3 引入无风险资产后的投资组合前沿 2.3.1 组合前沿的求解 2.3.2 组合前沿的性质 习题 第三章 静态资本资产定价理论 3.1 市场组合 3.1.1 不存在无风险资产的情形 3.1.2 存在无风险资产的情形 3.2 资本资产定价模型(capm) 3.2.1 零-贝塔capm 3.2.2 传统capm 3.3 capm的两个例子 3.3.1 效用函数取二次多项式时的capm推导 3.3.2 多变量正态分布下的capm推导 3.4 带约束的capm 3.4.1 禁止贷款时的capm 3.4.2 存、贷款利率不等时的capm 3.5 市场摩擦和capm的失效 习题 第四章 多期均衡资产定价理论 4.1 或有权益市场和配置效率 4.1.1 配置效率与或有权益的引入(一个例子) 4.1.2 模型的建立 4.1.3 pareto最优配置 4.1.4 完备市场竞争均衡 4.1.5 完备市场理性预期均衡 4.2 市场完备化与证券市场配置效率 4.2.1 配置效率与长生命证券的引入(一个例子) 4.2.2 模型的建立 4.2.3 证券市场理性预期均衡 4.2.4 代表性个体经济与分散经济价格过程的等价性 4.3 多期资本资产定价理论 4.3.1 模型的建立和求解 4.3.2 跨期capm的推导 4.4 股票溢金难题和无风险利率难题 4.4.1 问题的提出 4.4.2 相关研究进展 4.4.3 小结 习题 第五章 静态套利定价理论 5.1 套利机会 5.2 无套利定价的应用 5.3 因子模型与apt 5.3.1 因子模型 5.3.2 ross的apt理论 5.3.3 均衡套利定价理论 习题 第六章 离散时间跨期套利定价理论 6.1 介绍 6.2 无套利机会与等价鞅测度 6.2.1 模型的建立 6.2.2 无套利条件和等价鞅测度 6.2.3 消费计划的鞅性质 6.3 black-scholes公式的推导(二叉树方法) 6.3.1 模型的建立 6.3.2 等价鞅测度的求解 6.3.3 black-scholes公式的推导 习题 第七章 连续时间跨时套利定价理论 7.1 布朗运动 7.1.1 布朗运动的数学表述 7.1.2 随机微分方程和ito公式 7.2 black-scholes期权定价公式 7.2.1 特殊情形下的期权定价公式推导 7.2.2 一般情形下的期权定价公式推导 7.3 期权价格对参数的敏感性 习题 第八章 行为金融学基础 8.1 个体决策的不完全理性与行为经济(金融)学的兴起 8.2 前景理论 8.2.1 个体决策中的行为特征 8.2.2 前景理论的数学表述 8.2.3 前景理论及其应用 8.3 启发式认知偏差 8.3.1 启发式认知偏差的定义及组成 8.3.2 代表性偏差 8.3.3 可得性偏差 8.3.4 锚定效应 8.4 心理账户 8.4.1 问题的提出 8.4.2 心理账户的内涵 8.5 自我约束问题 8.5.1 问题的提出 8.5.2 双曲贴现效用函数 8.5.3 自我约束、拖延和偏好反转 8.5.4 应用研究 8.6 噪声交易者 8.6.1 噪声交易者的引入 8.6.2 噪声交易理论的应用 8.7 套利限制 8.7.1 套利限制 8.7.2 套利限制的应用 习题 参考文献

<<金融经济学教程>>

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>