

<<金融经济学十讲>>

图书基本信息

书名：<<金融经济学十讲>>

13位ISBN编号：9787543220225

10位ISBN编号：7543220229

出版时间：2011-11-1

出版时间：格致出版社,F_格致出版社

作者：史树中

页数：138

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>

<<金融经济学十讲>>

内容概要

这本《金融经济学十讲》由史树中著，全书内容包括：金融经济学的基本思想、二期证券市场的基本模型和线性定价法则、公司财务的莫迪利阿尼-米勒定理、马科维茨证券组合选择理论和资本资产定价模型、罗斯的套利定价理论(APT)和资产定价基本定理、冯·诺伊曼-摩根斯特恩期望效用函数、一般经济均衡与资产定价、布莱克-肖尔斯期权定价理论、有效市场理论、连续时间金融学。

<<金融经济学十讲>>

书籍目录

从数理经济学到数理金融学的百年回顾(代引言)

第一讲 金融经济学的基本思想

- 1.1 金融经济学简史及其基本文献
- 1.2 数学公理化方法及其有关争论
- 1.3 作者的态度
- 1.4 商(管理)学院学生为什么要学理论金融经济学
- 1.5 数学公理化方法的优势和缺陷
- 1.6 怎样用线性定价法则和无套利假设进行期权定价
- 1.7 一个简单的投资—消费模型及其与无套利假设的关系
- 1.8 有关教材、专著和综述论文的介绍

思考与练习

附录：狂怒的大女子主义者的寓言和股票市场

第二讲 二期证券市场的基本模型和线性定价法则

- 2.1 无不确定性的无套利假设定价法则
- 2.2 带不确定性的无套利假设定价法则
- 2.3 二期证券市场的基本模型及线性定价法则和随机折现因子
- 2.4 随机折现因子的初步讨论，无风险证券及其模仿组合
- 2.5 收益率超平面和超额收益率子空间
- 2.6 由随机折现因子理论导出资本资产定价模型和马科维茨证券组合选择理论
- 2.7 马科维茨证券组合选择理论、资本资产定价模型与线性定价法则之间的等价性

思考与练习

附录：数学预备知识1

第三讲 公司财务的莫迪利阿尼-米勒定理

- 3.1 莫迪利阿尼-米勒定理与线性定价法则
- 3.2 关于分红政策的莫迪利阿尼-米勒定理
- 3.3 关于资本结构的莫迪利阿尼-米勒定理

思考与练习

第四讲 马科维茨证券组合选择理论和资本资产定价模型

- 4.1 证券组合的收益率和证券组合选择问题
- 4.2 两种证券的证券组合选择问题
- 4.3 协方差矩阵正定的一般情形下的均值一方差证券组合选择问题的解
- 4.4 带无风险证券的均值一方差证券组合选择问题的解
- 4.5 二基金分离定理与资本资产定价模型
- 4.6 证券组合选择理论、资本资产定价模型和随机折现因子理论的等价性
- 4.7 不允许卖空的均值一方差证券组合选择问题

思考与练习

附录1：资本资产定价模型的夏普证明

附录2：数学预备知识2

第五讲 罗斯的套利定价理论(APT)和资产定价基本定理

- 5.1 渐近无套利假设和罗斯的APT方法
- 5.2 多因子模型与随机折现因子
- 5.3 有限状态情况下的资产定价基本定理
- 5.4 从阿罗-德布鲁证券出发来考虑资产定价基本定理
- 5.5 资产定价基本定理的证明
- 5.6 凸集分离定理与资产定价基本定理

<<金融经济学十讲>>

5.7 未定市场的一般经济均衡和资产定价第二基本定理

5.8 说明资产定价基本定理的一个简单例子

思考与练习

附录：数学预备知识3

第六讲 冯·诺伊曼-摩根斯特恩期望效用函数

6.1 “圣彼得堡悖论”的讨论

6.2 冯·诺伊曼-摩根斯特恩期望效用函数的公理化陈述

6.3 阿莱悖论和卡尼曼-特韦斯基的研究

6.4 阿罗-普拉特风险厌恶度量

6.5 若干典型期望效用函数

6.6 随机占优的概念

思考与练习

第七讲 一般经济均衡与资产定价

7.1 纯交换经济的数学表达

7.2 纯交换经济的一般经济均衡的存在定理

7.3 金融市场的一般均衡的存在

7.4 CAPM的均衡定价讨论

7.5 APT的均衡定价讨论

思考与练习

第八讲 布莱克-肖尔斯期权定价理论

8.1 布莱克-肖尔斯欧式买入期权定价公式

8.2 布莱克-肖尔斯公式的前驱

8.3 布莱克-肖尔斯公式的考克斯-罗斯-鲁宾斯坦(二叉树方法)推导

8.4 一般的有限状态多期模型

8.5 资产定价基本定理的新形式以及鞅的概念

8.6 更一般的多期模型及其与线性定价法则的联系

思考与练习

第九讲 有效市场理论

9.1 有效市场的通俗理解和讨论

9.2 有效市场假设的历史回顾

9.3 有效市场的检验

9.4 信息集的一种定义以及理性预期均衡

9.5 从理性预期均衡来看CAPM和APT

思考与练习

附录：有效市场假设的现状

第十讲 连续时间金融学

10.1 布朗运动、随机分析等的一些启发性叙述

10.2 随机分析的进一步叙述

10.3 连续时间的布莱克-肖尔斯模型和期权定价公式

10.4 布莱克-肖尔斯公式原来的推导

10.5 利率期限结构的连续时间模型

思考与练习

附录：布莱克-肖尔斯方程的求解

结语

后记

参考文献

<<金融经济学十讲>>

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>