

<<数理金融>>

图书基本信息

书名：<<数理金融>>

13位ISBN编号：9787030070241

10位ISBN编号：7030070240

出版时间：1998-12-1

出版时间：科学出版社

作者：叶中行,林建忠

页数：238

字数：267000

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>

<<数理金融>>

内容概要

本书主要内容包括：数理金融预备知识，资产组合均值-方差分析与资本资产定价模型，Ross套利定价理论，log-最优投资组合理论，有风险控制的log-最优投资组合，连续时间资产组合选择，期权定价理论，利率期限结构理论，公司资本结构理论，等等。

本书可供高校金融、管理、应用数学系师生作教材之用。

书籍目录

第一章 数理金融预备知识 1 序数效用理论 2 确定状态资产市场的一般套利定价定理(GAPT) 3 单周期确定状态经济系统的投资消费模型 4 单周期确定状态经济系统的竞争均衡定价 5 基数效用理论 6 单周期随机资产市场的一般套利定价定理(GAPT) 7 单周期随机经济系统的投资消费模型 8 风险厌恶与均值-方差效用函数 9 单周期随机经济系统竞争均衡定价 10 等价概率分布与风险中性定价 11 连续时间的扩散模型与Ito公式 12 首次击中时与带吸收状态的漂移Brown运动

第二章 资产组合均值-方差分析与资本资产定价模型(CAPM) 1 标准的均值-方差资产组合问题 2 具有无风险资产的均值-方差问题 3 期望收益率关系式与风险分类 4 资本资产定价模型 5 CAPM在资产定价中的应用

第三章 Ross套利定价理论(APT) 1 线性因子模型 2 不含残差风险线性因子模型的套利定价 3 含残差风险线性因子模型的套利定价 4 完全分散化资产组合与因子溢价的解释 5 APT应用案例

第四章 log-最优资产组合理论 1 倍率函数和log-最优资产组合 2 序列投资模型 3 投资决策中信息作用的模型 4 最优资产组合的计算方法

第五章 风险控制的log-最优资产组合 1 风险控制函数 2 倍率-风险函数和风险-倍率函数 3 r_{min} , r_{max} 和 r_c 的计算和估计 4 单因素线性回报模型 5 序列投资的倍率-风险函数 6 有风险控制最优资产组合的修正既约梯度算法

第六章 连续时间资产组合选择与跨期资本资产定价模型(ICAPM) 1 连续时间资产组合模型 2 连续时间跨期资本资产定价模型(ICAPM) 3 等弹性消费效用的投资消费问题求解 4 一类变系数连续时间资产组合模型 5 资产组合持有的解释 6 联系于变系数模型的跨期资本资产定价模型(ICAPM) 7 缺乏无风险资产下的连续时间模型 8 消费效用依赖于经济系统状态变量的连续时间模型 9 双曲绝对风险厌恶效用的投资消费问题求解

第七章 期权定价理论 1 期权概述 2 期权的基本性质 3 COX-Ross-Rubinstein二项式期权定价公式 4 欧洲期权定价的Black-Scholes公式 5 Black-Scholes未定权益定价方程解的概率表达式 6 基础股票支付红利的期权定价 7 美国卖出期权Black-Scholes方程的边界条件 8 基础股票支付红利的美国买入期权及其自由边界 9 自由边界的局部分析 10 向下触销(Down-And-Out)买入期权 11 永续期权 12 最优提早执行期权 13 执行价格为随机变量的期权 14 亚洲期权 15 远期合约与期货合约

第八章 利率期限结构理论 1 引言 2 确定利率的期限结构 3 预期假设 4 一种收益率曲线的简化模型 5 连续时间期限结构方程 6 仿射期限结构模型 7 Cox-Ingersoll-Ross利率模型及期限结构 8 Hull-White-Vaicek利率模型及期限结构 9 预期假设与均衡 10 多状态变量期限结构 11 流动性偏好理论与市场分割理论

第九章 公司资本结构 1 单周期确定投资情况的Modigliani-Miller无关性定理 2 单周期不确定投资情况的Modigliani-Miller定理 3 连续时间Modigliani-Miller无关性定理 4 考虑经济系统状态变量时的M-M定理 5 资本结构定价:引论 6 认股权证 7 风险贴现债券 8 利率风险结构 9 从属债券与有担保债券 10 可转换债券与可赎回债券 11 带有利率风险的公司证券的定价 12 流动利率债券设计 13 资本加权平均成本与ICAPM综合参考文献

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>