

<<数理金融>>

图书基本信息

书名：<<数理金融>>

13位ISBN编号：9787302287162

10位ISBN编号：7302287163

出版时间：2012-3

出版时间：清华大学出版社

作者：郭多祚 编

页数：270

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>

## 内容概要

《数量经济学系列丛书·数理金融：资产定价的原理与模型（第2版）》以资产定价为主线，讲述两种资产定价方法：无套利定价和均衡定价；讲述了各种资产定价的模型：债券定价模型，以股票为代表的风险资产的定价模型、金融衍生产品定价模型、期权定价模型，并按难易程度，首先讲述单期定价模型，然后讲述跨期定价模型。

《数量经济学系列丛书·数理金融：资产定价的原理与模型（第2版）》还介绍了MM理论以及行为金融学。

《数量经济学系列丛书·数理金融：资产定价的原理与模型（第2版）》适用于经济、管理类专业的本科生、硕士生教学，也适用于理工科专业学生的选修课，还可供从事金融工作的人员参考。

## 书籍目录

第1章 期望效用函数理论与单期定价模型1.1 序数效用函数1.1.1 偏好关系1.1.2 字典序1.1.3 效用函数1.1.4 偏好关系的三条重要性质1.1.5 序数效用函数存在定理1.2 期望效用函数1.2.1 彩票及其运算1.2.2 彩票集合上的偏好关系1.2.3 基数效用函数存在定理1.2.4 vonNeumann-Morgenstern效用函数1.2.5 伯瑞特率1.3 投资者的风险类型及风险度量1.3.1 投资者的风险类型1.3.2 马科维茨风险溢价1.3.3 阿罗-伯瑞特 (Arrow-Pratt) 绝对风险厌恶函数1.3.4 双曲绝对风险厌恶类函数 (HARA) 1.4 均值方差效用函数1.4.1 资产的收益率1.4.2 均值方差效用函数1.5 随机占优1.5.1 随机占优准则 (SD准则) 1.5.2 一阶随机占优1.5.3 二阶随机占优1.6 单期无套利资产定价模型1.6.1 单期确定性无套利定价模型1.6.2 单期不确定性无套利定价模型1.7 单期不确定性均衡定价模型1.7.1 均衡定价与期望效用最大化准则1.7.2 阿罗-德布鲁 (Arrow-Debreu) 证券1.7.3 多资产有限状态情况下的均衡定价模型1.7.4 均衡定价与无套利定价习题1

第2章 固定收益证券2.1 货币的时间价值2.1.1 终值2.1.2 现值与贴现2.1.3 多重现金流2.1.4 年金2.2 债券及其期限结构2.2.1 债券的定义和要素2.2.2 债券的风险2.2.3 债券的收益率及其计算2.2.4 债券的收益率曲线2.3 债券定价2.3.1 债券定价的原则2.3.2 影响债券定价的因素2.3.3 债券定价2.4 价格波动的测度——久期2.4.1 久期及其计算2.4.2 债券价格波动的特征2.4.3 债券价格波动的测量2.4.4 债券组合的久期2.4.5 利用久期免疫2.5 价格波动率的测度——凸度2.5.1 凸度及其计算2.5.2 凸度在价格波动测度中的作用2.5.3 凸度与价格变化幅度2.5.4 凸度的特性2.5.5 凸度的近似计算习题2

第3章 均值方差分析与资本资产定价模型 (CAPM) 3.1 两种证券投资组合的均值-方差3.1.1 投资组合3.1.2 联合线3.1.3 两种投资组合均值-方差分析3.2 均值-方差分析及两基金分离定理.....

第4章 套利定价理论 (APT) 第5章 期权定价理论第6章 多期无套利资产定价模型第7章 公司资本结构与MM理论第8章 连续时间消费资本资产定价模型第9章 行为金融学简介

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>