

<<微观金融经济理论>>

图书基本信息

书名：<<微观金融经济理论>>

13位ISBN编号：9787504457288

10位ISBN编号：7504457280

出版时间：2006-9

出版时间：中国商业出版社

作者：李德荃

页数：386

字数：336000

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>

## <<微观金融经济理论>>

### 内容概要

本书主要以市场经济系统中的金融市场为背景，针对投资者、中介者和融资者等微观主体的行为展开分析与研究，把探求各微观经济行为主体的决策规律，确定金融资产均衡价格的形成机制做为学科理论的研究重点。

## &lt;&lt;微观金融经济理论&gt;&gt;

## 书籍目录

## 第一章 市场风险及其传导机制

- 一、市场风险的属性
- 二、市场风险的一般性定义有其数学表达方式
- 三、市场风险的传导机制

## 第二章 市场风险的测量

- 一、风险主观概率分布的定义
- 二、风险先验主观概率分布的确定
- 三、后验概率分布的确定与贝叶斯学习过程

## 第三章 市场风险的效用

- 一、确定性环境下效用函数的存在性
- 二、风险决策环境的引入
- 三、投资者的风险态度

## 第四章 市场风险管理的基本逻辑

- 一、决策的类型
- 二、风险管理决策的基本逻辑
- 三、随机优势决策策略
- 四、“均值-方差”分析框架的引入及其有效性分析
- 五、群决策方法

## 第五章 风险管理对决策人效用的影响

- 一、组合投资的风险分散效应
- 二、合伙投资的风险分散效应
- 三、风险管理对企业价值的影响
- 四、风险转嫁的效应

## 第六章 证券组合理论

- 一、资产组合边界的确定
- 二、有效资产组合边界的确定
- 三、包含无风险资产的有效边界
- 四、市场均衡定价模型

## 第七章 套利定价模型

- 一、无非系统性风险资产的套利定价模型
- 二、渐近套利定价模型
- 三、A<sub>T</sub>与CAPM之间的关系

## 第八章 (单时期)金融资产的均衡定价策略

- 一、单时期金融市场的无套利均衡分析
- 二、单时期金融市场的一般均衡分析

## 第九章 离散多期金融市场的无套利均衡分析

- 一、离散多期模型的引入
- 二、二项树离散多期金融市场模型
- 三、鞅定价法

## 第十章 布莱克-斯科尔斯期权定价模型

- 一、作为随机过程的金融资产价格波动
- 二、布莱克-斯科尔斯期权定价模型

## 主要参考文献

<<微观金融经济理论>>

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>