

<<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：9787208051461

10位ISBN编号：7208051461

出版时间：2004-1

出版时间：上海人民出版社

作者：史树中

页数：258

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>>

前言

一般经济均衡理论和数学公理化 1874年1月，在瑞士洛桑大学拥有教席的法国经济学家瓦尔拉斯(L. Walras, 1834—1910)发表了论文《交换的数学理论原理》，首次公开他的一般经济均衡理论的主要观点。

虽然通常认为数理经济学的创始人是法国数学家、经济学家和哲学家古诺(A. A. Cournot, 1801—1877)，他在1838年出版了《财富理论的数学原理研究》一书，但是对今日的数理经济学影响最大的是瓦尔拉斯的一般经济均衡理论。

尤其是，直到现在为止，一般经济均衡理论仍然是惟一的、对经济整体提出的理论。

. 所谓一般经济均衡理论大致可以这样来简述：在一个经济体中有许多经济活动者，其中一部分是消费者，一部分是生产者..

<<金融经济学十讲>>

内容概要

现代金融理论是近几十年来经济学领域发展最引人注目的分支，不仅产生了多位诺贝尔经济学奖得主，而且其精美的模型和思想直接或间接地被运用于金融市场和投资实践，得到广泛认可。

《金融经济学十讲》是一本金融经济学的研究生教材，作者在多年教学、科研活动的基础上，以“未定权益希尔伯特空间”为新的出发点探讨了金融经济学，介绍了金融经济学的发展概貌，梳理了大量的相关文献，以数学公理化方法着重从理论角度讨论了会展经济学中的重要理论和模型。

<<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—方差证券组合选择问题的解4.4 带无风险证券的均值—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—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>