第一图书网, tushu007.com

<<金融经济学原理>>

图书基本信息

书名：<<金融经济学原理>>

13位ISBN编号：9787302275435

10位ISBN编号：7302275432

出版时间：2012-4

出版时间：清华大学出版社

作者：（美）勒罗伊，（美）沃纳　著，汪建雄，何雪飞　译

页数：302

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

《金融经济学原理》向经济学专业的研究生介绍金融经济学的知识。
由于几乎所有金融经济学的主要思想都可以在两期模型的背景下展开，所以本书的重点放在详细研究两期模型上。
本书严密的分析可以和微观经济学中最出色的著作相提并论。
与此同时，作者还提供了充足的讨论和例子，令金融经济学的主要思想可以很容易被读者理解。

作者简介

斯蒂芬·F.勒罗伊，美国加州大学圣塔芭芭拉分校的经济学教授。
1991-1996年间，他在明尼苏达大学卡尔森管理学院任职为金融学教授。
此前曾任教于芝加哥大学、加州大学伯克利分校和加利福尼亚技术研究所。

简·沃纳，美国明尼苏达大学经济学副教授。
曾任教于伯恩大学和庞裴法布拉大学巴塞罗那分校。

勒罗伊教授和沃纳教授的研究成果已在众多著名的杂志上发表，其中包括Internationa/Economic Review，Econometrica，Journa/of Economic Theory等。

汪建雄，1982年11月生，2003年本科毕业于江西财经大学金融学院，2009年硕士毕业于江西财经大学金融学院，2010年9月入中央财经大学中国经济与管理研究院攻读博士学位。

感兴趣的研究方向：金融经济学、金融危机与银行风险管理、经济制度史。

何雪飞，1989年1月生，2010年本科毕业于中央财经大学中国经济与管理研究院，2010年9月入中央财经大学中国经济与管理研究院攻读经济学硕士学位。

感兴趣的研究方向：金融经济学、计量经济学。

书籍目录

第1篇 均衡与套利
第1章 证券市场中的均衡
1.1 引言
1.2 证券市场
1.3 个体
1.4 对消费和资产组合的选择
1.5 一阶条件
1.6 矩阵的左逆和右逆
1.7 一般均衡
1.8 均衡的存在性和唯一性
1.9 代表性个体模型
1.10 评注
第2章 线性定价
2.1 引言
2.2 一价法则
2.3 收益定价泛函
2.4 线性均衡定价
2.5 完备市场中的状态价格
2.6 对最优化问题的重述
2.7 评注
第3章 套利和正定价
3.1 引言
3.2 套利和强套利
3.3 图解表示
3.4 收益定价泛函的正性
3.5 正状态价格
3.6 套利和最优资产组合
3.7 正均衡定价
3.8 评注
第4章 资产组合约束
4.1 引言
4.2 卖空限制
4.3 卖空限制下的资产组合选择
4.4 一价法则
4.5 限制套利和未限制套利
4.6 图解表示
4.7 买卖价差
4.8 均衡中的买卖价差
4.9 评注
第2篇 估值
第5章 估价
5.1 引言
5.2 金融学基本定理
5.3 依存权益的价值界
5.4 延拓

5.5 估价泛函的唯一性
5.6 评注
第6章 状态价格和风险中性概率
6.1 引言
6.2 状态价格
6.3 Farkas-Stiemke引理
6.4 图解表示
6.5 状态价格和价值界
6.6 无风险收益
6.7 风险中性概率
……
第3篇 风险
第4篇 最优资产组合
第5篇 均衡定价和配置
第6篇 均值—方差分析
第7篇 多期证券市场
第8篇 证券价格的鞅性质
索引
译后记

媒体关注与评论

长期以来，我们急需一本适合博士新生的金融学原理现代处理方法的教材：这本严密的、精心构思且十分优秀的教科书非常适合这一需要。
——麻省理工学院教授，APT定价理论提出者（斯蒂芬·A.罗斯）　　勒罗伊和沃纳沿着清晰的传统思路介绍了金融经济学。
本书对于资产定价理论的覆盖范围令人难忘，必将成为博士研究生学习金融学和经济学的标准，以及进入该领域文献的光辉起点。
——斯坦福大学教授，经典教材《动态资产定价》作者（达雷尔·达菲）　　现代金融学主要是研究资产定价和收益无套利的含义。
勒罗伊和沃纳提供了该理论清晰严密的发展，并展示了如何使用该理论阐述资产组合问题。
——明尼苏达大学教授，2004年诺贝尔经济学奖获得者（爱德华·C.普雷斯科特）

第一图书网, tushu007.com

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