

<<资产定价原理>>

图书基本信息

书名：<<资产定价原理>>

13位ISBN编号：9787505889729

10位ISBN编号：7505889729

出版时间：2010-4

出版时间：经济科学出版社

作者：邹辉文

页数：323

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>

## <<资产定价原理>>

### 内容概要

本书是以连续时间为主的金融经济学，即以连续时间情形下一般经济均衡分析和无套利均衡分析来说明资产定价的基本原理。

本书重点突出资产定价的基本原理和方法，强调理论的内在联系和逻辑关系。遵循循序渐进的思想，适当介绍离散情形的理论，在此基础上再论述连续时间情形的理论，并尽可能地辅之以它们在具体情况下的应用，这样便于读者对比分析，相互印证，加深对资产定价原理的理解。

本书可供金融专业的大学本科高年级学生和研究生，以及金融理论研究人员和金融从业人员学习参考。

## &lt;&lt;资产定价原理&gt;&gt;

## 书籍目录

第一章 无套利与资产定价 第一节 状态依存向量、无套利组合与冗余资产 第二节 无套利条件与市场一价法则 第三节 完备市场和线性定价法则 第四节 资产定价基本定理 第五节 二项式期权定价公式 第六节 资产定价基本定理的多期形式第二章 一般经济均衡与资产定价 第一节 一般经济均衡条件与无套利条件的关系 第二节 资产市场一般均衡的存在性 第三节 一般经济均衡框架下的CAPM 第四节 多时期市场中资产的均衡定价第三章 连续时间资产价格与其随机微分方程 第一节 动态资产价格的鞅性质与随机差分方程 第二节 维纳(Wiener)过程与资产价格扩散过程 第三节 随机积分与资产价格随机微分方程 第四节 伊藤引理第四章 连续时间的一般经济均衡与资产定价 第一节 常系数情形下连续时间跨期资产定价模型 第二节 一维变系数情形下连续时间跨期资产定价模型 第三节 多维变系数情形下连续时间跨期资产定价模型 第四节 基于消费的连续时间跨期资产定价模型 第五节 动态完备市场的连续时间最优消费和投资组合准则 第六节 连续时间一般经济均衡模型与资产定价模型第五章 连续时间的无套利与等价鞅测度 第一节 鞅转换与格沙诺夫(cirsanov)定理 第二节 投资策略的自融资性和套利机会 第三节 等价鞅测度与无套利条件 第四节 等价鞅测度的存在性与唯一性 第五节 完备市场与冗余资产定价第六章 连续时间衍生资产的无套利定价 第一节 衍生资产定价的一般方法 第二节 等价鞅测度与欧式期权定价 第三节 标的资产支付红利时的欧式期权定价 第四节 美式期权定价 第五节 远期合约和期货合约的定价 第六节 互换合约的定价第七章 连续时间公司资本定价与资本结构 第一节 公司资本定价的一般模型 第二节 公司资本定价的分类模型 第三节 公司债券的风险结构 第四节 经典条件下的M-M定理 第五节 较弱条件下M-M定理的变形 第六节 加权平均资本成本与ICAPM综合第八章 连续时间利率期限结构理论 第一节 离散时间确定利率的期限结构 第二节 连续时间确定利率的期限结构 第三节 连续时间随机利率的期限结构理论 第四节 连续时间随机利率的期限结构方程 第五节 仿射期限结构模型 第六节 若干随机利率模型及期限结构参考文献后记

<<资产定价原理>>

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>