

<<金融经济学>>

图书基本信息

书名：<<金融经济学>>

13位ISBN编号：9787802074576

10位ISBN编号：7802074576

出版时间：2006-1

出版时间：经济管理

作者：张连增

页数：175

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>

## &lt;&lt;金融经济学&gt;&gt;

## 内容概要

本书内容可分为两部分：无套利理论与方法、利率敏感性金融工业定价。

这两部分内容有一些交叉（如在利率敏感性金融工具定价时，无套利假设几乎是一个最基本的假设），但其侧重点不同。

本书包括十章内容，其中前六章内容主要来自《金融经济学》，而后四章内容来自《利率敏感性金融工具评价》。

下面简单地加以介绍。

第一章重点对金融市场上的资产与衍生证券作一介绍，另外简单介绍了市场上的利率度量以及比较经典的马可维茨模型。

第二章讨论均衡定价理论，它表明了市场上买卖双方如何通过交易而导致均衡价格。

第三章讨论无套利定价理论，它表明给定原始证券的价格后，衍生证券的价格可表示为关于风险中性概率（或等价鞅测试）的期望。第四章是第三章的具体应用，在本章中一些定理的复杂证明暂时略去。

第五章讨论了利率的期限结构。

第六章是关于连续时间的期权无套利定价问题。

第七章首先总结性地介绍四种类型的利率（即期利率、远期利率、短期利率、满期收益率）及其相互关系，这些不同类型的利率是理解后面各种评价方法的关键。

第八章和第九章分别讨论了利率期限结构的离散时间和单因素模型和连续时间单因素模型。

第十章讨论离散时间模型和连续时间模型的关系。

## 书籍目录

上篇 无套利理论与方法 第一章 金融市场 一、货币市场 二、股票与债券市场 三、利率 四、风险与收益：马可维茨模型 五、衍生证券 第二章 均衡定价 一、引言 二、不确定条件下的决策：期望效用假设 三、证券市场的单周期模型 四、基于代理人代表的模型 五、资本资产定价模型的推导 六、Black-Scholes期权定价公式 第三章 无套利定价理论 一、单周期模型 二、多周期模型 三、多周期模型的随机过程处理 第四章 期权与其他衍生证券 一、期权定价的二叉树模型 二、非典型衍生产品 三、数值方法 四、一些度量 第五章 利率期限结构模型 一、收益曲线 二、无套利率模型 三、利率衍生工具的定价 四、二叉树利率模型 五、Black-Derman-Toy模型的实现 第六章 连续时间的期权定价 一、股票价格模型 二、或然请求权及其价格 三、几何布朗运动模型 四、关于两种股票的期权 五、有分红的股票价格模型 六、不完备市场模型 下篇 利率敏感性金融工具定价 第七章 利率敏感性现金流的评价 一、各种利率及其关系 二、利率敏感性现金流的评价 附录 满期收益率与即期利率的关系 第八章 离散时间单因素模型 一、引言 二、一个简单的例子 三、由无套利决定的关于期限结构的限制 四、无套利模型 第九章 连续时间单因素模型 一、利率期限结构 二、利率或有证券 附录 Ito公式 第十章 单因素模型的求解方法 一、B-S期权评价模型 二、数值求解方法 参考文献

### 编辑推荐

本书内容可分为两部分：无套利理论与方法、利率敏感性金融工具定价。这两部分内容有一些交叉，但其侧重点不同。本书讨论的定价问题是金融经济学中的重要专题。本书讨论资产与衍生工具定价，侧重于技术性的定量处理。本书包括十章内容，其中前六章内容主要来自《金融经济学》，而后四章内容来自《利率敏感性金融工具评价》。

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>