

<<连续时间金融>>

图书基本信息

书名：<<连续时间金融>>

13位ISBN编号：9787300063638

10位ISBN编号：7300063632

出版时间：2005-1

出版时间：人民大学

作者：莫顿

页数：627

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>

## <<连续时间金融>>

### 内容概要

《连续时间金融》（修订版）从代理人可以在连续时间中调整其决策这样一个模型出发，发展了金融数学和金融经济理论。

时间和不确定性是影响金融经济行为的核心要素。

也正是时间和不确定性二者相互作用的复杂性，为金融研究提出了智力上的挑战并使之激动之心。

正确分析二者相互作用的影响，通常需要复杂的分析工具。

实际上，高深的数学训练已经成为本领域研究者必备的条件。

然而，尽管它的数学很复杂，但金融理论还是对金融实践产生了直接的、巨大的影响。

只要我们随便将当前的实践与20年前的实践比较一下，就足以发现有效市场理论、投资组合选择、风险分析以及未定权益定价理论对货币管理、金融中介机构、投资银行、公司金融以及资本预算程序所产生的冲击；人们甚至还能发现金融理论对法律问题产生的影响，例如涉及到资产评估的案件、对受管制行业收益率的听证以及对监管那些信托机构“精明人”行为创新的浪潮中，金融理论所起的作用。

。

## <<连续时间金融>>

### 作者简介

罗伯特·C·默顿是哈佛大学商学院乔治·费雪·贝克尔讲座教授。

罗伯特·C·默顿这本被广泛使用的著作，从连续时间分析的角度，提供了金融理论的概述和综合。它包括个人金融选择，公司金融、金融中介、资本市场，以及私人与公共金融交叉领域选择中的一些主题。

在本修订版中，新增加了大学捐赠基金管理的内容。

保罗·萨缪尔森为本书作序。

## 书籍目录

第1篇 连续时间模型的金融基础和数学基础第1章 现代金融学第2章 投资组合选择和资本市场理论导论：静态分析第3章 连续时间模型的数学和经济学假设第2篇 连续时间模型中的最优消费和投资组合选择第4章 不确定情况下的投资组合选择：连续时间情形第5章 连续时间模型中的最优消费和投资组合准则第6章 最优消费理论和投资组合选择的进一步发展第3篇 认股权证和期权定价理论第7章 效用最大化的认股权证定价完全模型第8章 理性期权定价理论第9章 标的股票收益不连续条件下的期权定价第10章 期权定价理论的进一步发展第4篇 公司财务和金融中介理论的未定权益分析第11章 资产市场的一般均衡模型及其在公司资本结构定价中的应用第12章 公司债务定价：利率的风险结构第13章 未定权益定价和莫迪利亚尼-米勒定理第14章 连续时间模型中的金融中介机构第5篇 金融跨期均衡理论第15章 跨期资本资产定价模型第16章 连续时间金融的完全市场一般均衡理论第6篇 连续时间模型在某些公共财政问题中的应用：长期经济增长、公共养老金计划、存款保险和贷款担保第17章 不确定条件下增长的渐进理论第18章 基于消费指数化的公共养老金计划第19章 存款保险和贷款担保成本的缘由解析：现代期权定价理论的应用第20章 存在监管成本时的存款保险成本第21章 大学捐赠基金的最优投资策略参考文献人名索引主题索引

媒体关注与评论

我不能想像，一个人在研究不确定条件下的跨期资产定价问题时，怎么能够不非常认真地学习罗伯特·C·默顿过去和现在的研究成果。

因此，布莱克韦尔出版社的这本书，对金融学界和实际部门大有裨益。

这是一本逻辑清晰而内容紧凑的书，它相当于连续时间金融学中的圣经。

对金融经济学有兴趣的任何人，都会意识到罗伯特·C·默顿的杰出成就。

对这些人来说，默顿的书是不会令他们捻的，他的这本书在今后好多年内毫无疑问地是一本经典的参考书。

从广度和深度上讲，本书是将博士生引入连续时间金融的理想教材。

<<连续时间金融>>

编辑推荐

鉴于《连续时间金融》（修订版）从头至尾都运用连续时间模型的分析方法，把该模型作为金融理论的综合体和分水岭来评价它的背景也许是合乎逻辑的。

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>