<<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。

<<连续时间金融>>

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章期权定价理论的理一步发展第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

<<连续时间金融>>

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。

<<连续时间金融>>

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