第一图书网, tushu007.com

<<公司财务理论>>

图书基本信息

书名：<<公司财务理论>>

13位ISBN编号：9787310030187

10位ISBN编号：7310030184

出版时间：2008-10

出版时间：南开大学出版社

作者：尹晓冰

页数：206

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

本书包括九个相互联系的章节。
第一章介绍了金融市场的作用和分离定理；第二章介绍了非确定性投资决策和风险态度；第三章介绍了Markowitz证券组合理论；第四章介绍了资本资产定价理论及其实证检验；第五章完整地介绍了现代资本结构理论，特别是完整地推导了原始MM理论、引入公司所得税的MM理论和引入个人所得税的MM理论（税差模型），以及Ross模型；第六章介绍了现代债券定价定理和久期与凸度的技术；第七章介绍了股票期货与股指期货的定价理论与应用：第八章介绍了期权价格的性质和二叉树期权定价理论；第九章介绍了基于股价行为理论的：BSM模型；最后附上了两篇关于公司财务理论当中具体问题的研究论文。
对于经济学、工商管理、财务管理、会计学等专业的硕士研究生而言，阅读本书可以充分了解这些理论的来龙去脉和逻辑推理过程，从而掌握其核心思想和精神实质。
对于准备博士研究生入学考试者而言，本书是一本不可多得的读书笔记。

<<公司财务理论>>

书籍目录

前言第一章　金融市场的作用和分离定理第一节　没有金融市场条件下的跨期消费一投资选择一、投资机会曲线二、无差异曲线三、没有金融市场的跨期消费一投资选择第二节　存在金融市场情况下的跨期消费一投资一、消费总现值二、金融市场线和等现值线三、跨期消费总现值的最大化四、通过金融市场借贷情况下的跨期消费一投资选择第三节　分离定理和金融市场的作用一、分离定理：投资决策与融资决策的分离二、金融市场的作用第二章　非确定性投资决策与风险态度第一节　不确定性和风险一、确定性、风险性和不确定性投资二、风险的测量第二节　不确定性投资的目标一、收益最大化二、期望收益最大化三、期望效用最大化第三节　期望效用理论一、基本公理二、风险态度三、不同投资者的风险态度四、不同投资者的无差异曲线第三章　Markowitz证券组合理论第一节　股票收益率分析一、股票收益率的测度和分布二、个别股票收益率的预期收益和风险三、股票组合的预期收益和风险第二节　Markowitz证券组合理论一、Markowitz证券组合二、Markowitz有效前沿三、引入无风险债券的Markowitz有效前沿四、分离定理五、市场证券组合的构成第四章　资本资产定价模型及其实证检验第一节　CAPM的推导一、资本市场线CML二、证券Si和市场证券组合M构造的新组合P三、资本资产定价模型四、资本资产定价模型的隐含条件五、β的含义六、证券市场线第二节　单因素模型、单指数模型和市场模型一、单因素模型二、单指数模型三、分散化的效果四、证券特征线（Securities Character Line，SCL）第三节　CAPM的检验一、早期的检验方法二、Roll的批判三、Fama-French的发现第五章　现代资本结构理论第一节　MM理论之前的资本结构理论一、净收入理论二、净营运收入理论三、传统理论第二节　MM理论及其发展一、无税的Modigliani-Miller理论二、引入公司所得税的MM理论三、引入公司所得税和个人所得税的MM理论四、MM理论的内在统一第三节　引入财务拮据成本（含代理成本）的资本结构理论一、财务拮据成本和税盾同时影响下的资本结构理论二、引入财务拮据成本和个人所得税的资本结构理论三、代理成本作用下的权衡理论第四节　不对称信息条件下的资本结构理论一、信号传递分析（Signaling Approach）二、优序融资理论（Pecking Order Theory）附录1：利用CAPM证明MM理论附录2：最佳资本结构的确定第六章　债券的久期与凸度第一节　债券定理一、债券的内在价值二、债券投资的风险三、债券定理第二节　久期及其性质一、久期的概念二、久期的性质三、有效久期第三节　凸度及其性质一、凸度的概念二、凸度的用途三、凸度免疫第七章　股票期货与股指期货的定价理论与应用第一节　股票期货与股指期货定价理论一、不付红利情况下，股票现货价格与期货价格的关系二、支付红利情况下，现货价格与期货价格的关系三、股指期货的价格及其增长率第二节　股指期货的交易策略一、β对冲二、调整组合的β系数三、最佳对冲比率第八章　期权的二叉树定价方法第一节　期权价格的基本特征一、影响期权价格的因素二、假设和符号三、期权价格的上、下限四、买权和卖权的平价关系五、提前执行六、红利的影响第二节　二叉树定价方法一、一个一步二叉树的特例二、一般化的一步二叉树三、风险中性估值四、二步二叉树五、欧式期权的二步二叉树六、美式期权七、多步二叉树八、使用波动率σ确定υ和d九、二叉树方法的总结（二步为例）第九章　股价行为和BSM模型第一节　股价行为的模型一、股价的Markov性二、Wiener Processes三、Generalized Wiener Processes四、Ito Processes五、股价的变化过程六、漂移率（Drift rate）、方差率（Variance rate）和波动率（Volatility）第二节　Ito Lemma一、Ito Lemma二、股票期货和股价的对数服从的随机过程第三节　Black-Scholes-Merton期权定价模型一、股价和股价的连续复收益率的概率分布二、期权和股票的对冲组合三、B-S-M偏微分方程四、B-S-M偏微分方程的解法附文1：公司治理与公司价值：新制度分析附文2：全流通发行制度下的IPO抑价问题研究

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