

<<数理金融分析>>

图书基本信息

书名：<<数理金融分析>>

13位ISBN编号：9787505860476

10位ISBN编号：750586047X

出版时间：2007-2

出版时间：经济科学出版社

作者：张永林

页数：284

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>

<<数理金融分析>>

内容概要

本书是数理金融学的基础性著作，内容涵盖了现代货币金融理论，消费（包括家庭理财）与投资（包括公司理财）理论，金融市场与资产组合理论，各种资产（期货、证券、期权和债券）的定价理论，金融风险理论，现代金融学研究的方法和模型以及金融实务的数学分析方法，等等。

本书可供高等院校经济、管理和应用数学专业师生使用，尤其适合本科高年级和研究生一年级学生使用。

本书也是经济和金融专业从业人员的业务参考书。

书籍目录

第1章 现代货币金融理论和消费——投资组合分析 1.1 引言 1.2 现代货币需求原理与效用和生产模型 1.3 货币的时间价值、利率与资产收益率 1.4 单时期消费和投资 1.5 多时期消费和投资 1.6 生命周期原理与家庭理财 附录1 单时期投资组合模型 思考题第2章 金融市场和资产组合分析 2.1 引言 2.2 金融市场与金融资产的基本概念 2.3 不确定的市场与资产价值 2.4 不确定性与金融风险 2.5 风险管理与风险投资模型 2.6 公司理财与莫迪利亚尼——米勒定理 (M-M定理) 2.7 金融市场结构与效率分析 附录2 金融市场一般均衡理论 思考题第3章 均值—方差原理和资产定价 3.1 引言 3.2 最优资产组合与资产定价原理 3.3 资本资产定价模型 3.4 一般金融资产定价模型 3.5 多时期资产选择与二凡树定价模型 附录3 资本市场一般均衡型及其应用 思考题第4章 期权定价理论和套利分析 4.1 引言 4.2 期权、期货与衍生金融资产 4.3 期权的动作与期权定价原理 4.4 期权价格的维纳——布朗过程与Black-Scholes定价理论 4.5 二叉树模型与期权定价 4.6 期权价格与套利理论 4.7 套利定价 (APT) 模型与有效市场理论 附录4 Black-Scholes期权定价公式的简单推导 思考题第5章 利率理论和债券定价 5.1 引言 5.2 利率衍生证券和债券定价原理 5.3 利率期限结构理论 5.4 利率、收益率和债券定价模型 附录5 公司债务定价和未定权益定价理论 思考题第6章 最优化理论和现代金融分析 6.1 引言 6.2 消费——投资组合最优化模型 6.3 资产组合的最优化模型与线性规划方法 6.4 金融研究的博弈论模型 6.5 新经济增长理论和现代金融研究 思考题参考文献

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>