

<<动态资产定价理论>>

图书基本信息

书名：<<动态资产定价理论>>

13位ISBN编号：9787810499972

10位ISBN编号：7810499971

出版时间：2004-5

出版时间：上海财经大学出版社

作者：达雷尔·达菲

页数：451

字数：638000

译者：潘存武

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>

## <<动态资产定价理论>>

### 内容概要

本书主体内容分为两部分，共12章。

而且，作者为了使读者更好地阅读本书，还提供了10个附录。

此外，为了方便读查阅，作者还提供了大量参考资料、人名对照表和术语对照表。

书中的10个附录。

此外为了方便读者查阅，作者还提供了必备的数学背景知识，主要是有关概率论和随机过程的数学知识。

主体内容的第一部分共有4章。

均是围绕着离散时间和离散状态（空间）下的资产定价问题展开论述。

第1章介绍最基本的单段时期资产定价理论模型。

第2章则把第1章的内容推广到多期的情形。

第3章阐述第2章内容在马尔可夫情景下的动态规划情形，著名的何和李模型以及布莱克—德曼—托尔期限结构模型就被作为练习包含在第3章中。

第4章把第3章的内容推广到无限时间视野的情形，即所谓的卢卡斯模型。

## <<动态资产定价理论>>

### 作者简介

作者达雷尔·达菲（Darrell Duffie），是斯坦福大学产学研研究生院的教授，其研究的主要领域为资产定价、风险和管理、信用风险建模，以及固定收益证券和股票市场，在国际上享有很高的知名度。

## <<动态资产定价理论>>

### 书籍目录

第一篇 离散时间模型 1 状态定价引论 1.1 套利和状态价格 1.2 风险中性概率 1.3 最优化及资产定价 1.4 有效性和完备市场 1.5 最优化与代表性行为人 1.6 状态价格贝塔模型 2 基本的多期模型 2.1 不确定性 2.2 证券市场 2.3 套利、状态价格和鞅 2.4 单个行为人最优化 2.5 均衡和帕累托最优 2.6 均衡资产定价 2.7 套利和鞅测度 2.8 富余证券的价值 2.9 美式履约方针和定价模型 3.10 提前履约最优吗 习题 注释 3 动态规划法 3.1 贝尔曼法 3.2 一阶贝曼条件 3.3 马尔可夫不确定性 3.4 马尔可夫资产定价 3.5 马尔可夫控制下的证券定价 3.6 马尔可夫无套利定价 习题 注释..... 4 无限时期情形第二篇 连续时间模型 5 布莱克-斯科尔斯模型 6 状态价格和等价鞅测度 7 期限结构模型 8 衍生证券定价 9 证券组合和消费选择 10 均衡 11 公司证券 12 数值方法附录人名对照表术语对照表参考文献

<<动态资产定价理论>>

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>