第一图书网, tushu007.com

<<金融市场中的经济学与数学导论>>

图书基本信息

书名：<<金融市场中的经济学与数学导论>>

13位ISBN编号：9787810988704

10位ISBN编号：7810988700

出版时间：2007-5

出版时间：上海财经大学出版社

作者：亚克沙·萨维塔尼奇

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

这是一本由数理金融学领域两位著名专家撰写的关于现代金融经济重要思想的复杂的而又极具可读性的教材。
用一种非常清晰而又极具可读性的方式为我们介绍了现代金融市场的结构、背景及理论。
共分为三篇。
第一篇主要包括基础证券、金融市场机构、利率的概念、主要的数学模型以及各种测度市场交易风险和回报的方法等内容。
第二篇主要讲述期权定价和套期保值，该部分类似的内容实际上在最近关于金融市场的书籍中都有所提及。
第三篇主要讲述金融经济学的一个重要主题：利用均衡方法进行资产定价。
该部分由于在期权定价和套期保值方面几乎没有直接的应用，因此，它们通常被关于金融数学方面的书籍所忽略，然而，该理论却能对市场参与者的行为以及价格在市场中的形成机理给出定性的认识。
它既适用于硕士水平的课程也适用于初级博士的课程。
同时，它还适合各个学科的学生，如经济学、金融学或应用数学。

书籍目录

注释前言第一篇 市场、模型、利率、效用最大化、风险 1 金融市场 1.1 债券 1.2 股票 1.3 衍生产品 1.4 金融市场组织 1.5 保证金 1.6 交易成本 小结 习题 进一步阅读 2 利率 2.1 利率的计算 2.2 现值 2.3 利率期限结构与远期利率 小结 习题 进一步阅读 3 金融市场中的证券定价模型 3.1 单期模型 3.2 多期模型 3.3 连续时间模型 3.4 利率模型 3.5 名义利率和实际利率 3.6 套利与市场完备性 3.7 附录 小结 习题 进一步阅读 4 最优消费组合策略 4.1 偏好关系和效用函数 4.2 离散时间下的效用最大化 4.3 连续时间下的效用最大化 4.4 效用最大化中的对偶鞅方法 4.5 交易成本 4.6 不完全信息和非对称信息 4.7 附录：动态规划原理的证明 小结 习题 进一步阅读 5 风险 5.1 风险与回报：均值一方差分析 5.2 VaR：受险值 小结 习题 进一步阅读第二篇 衍生证券的定价与套期保值 6 套利与风险中性定价 6.1 看涨期权与看跌期权的套利关系：平价关系 6.2 远期与期货的套利定价 6.3 风险中性定价 6.4 附录 小结 习题 进一步阅读 7 期权?价 8 固定收益市场模型和衍生产品 9 套期保值 10 债券套期保值 11 数值方法第三篇 均衡模型 12 均衡原理 13 资本资产定价模型 14 多因子模型 15 其他的纯交换均衡 16 附录：概率论知识参考文献

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