

# 《数理金融学导论》

## 图书基本信息

书名：《数理金融学导论》

13位ISBN编号：9787040224290

10位ISBN编号：7040224291

出版时间：2007-11

出版社：高等教育

作者：张永林

页数：234

版权说明：本站所提供下载的PDF图书仅提供预览和简介以及在线试读，请支持正版图书。

更多资源请访问：[www.tushu111.com](http://www.tushu111.com)

## 前言

1. 现代金融学的理论、方法和技术 经济学是一门关于如何优化配置有限资源的学问。金融学属于应用经济学。现代金融学的核心是解决不确定环境下如何在时间上最优配置资源，以及分析市场和经济组织在资源配置中的作用。研究跨时期消费与投资最优组合、资产价值评估和风险管理是其三大支柱。市场效率分析、收益和风险分析、金融机构分析、家庭和企业行为分析，是其四种分析角度。从这样的视角来看，金融学的主要问题是：资产价值评估问题——金融市场如何确定资产的价格；个体理财问题——个体（家庭）如何进行金融/财务决策；公司财务（企业理财）问题——公司（企业）如何进行金融/财务决策。以1952年Markowitz资产组合选择理论和1973年Black-Scholes期权定价理论为标志的两次“华尔街革命”以后，现代金融学的宏伟大厦拔地而起。尤其是近20年来，以有效市场、投资组合选择、风险分析以及未定权益定价为代表的金融理论，和以货币管理、金融中介机构、投资银行、公司金融以及家庭理财为代表的金融实务，发展相当迅速，超越了经济学的其他领域。

# 《数理金融学导论》

## 内容概要

《数理金融学导论》是现代金融学数理方法的基础性教材。

《数理金融学导论》第1章至第3章是现代金融学的基础方法与理论基础，内容涵盖了现代金融研究的基本模型，金融市场与风险理论，消费与资产组合理论。

第4章至第6章是金融资产价值理论及其定价方法，内容涵盖了各种资产（期货、证券、期权和债券）的定价理论及其模型。第7章和第8章是现代金融行为分析和应用金融学，主要内容包括公司财务和行为金融学基础。

《数理金融学导论》体系完整，结构合理，根本任务是给出数理金融学的基本框架。

《数理金融学导论》可供高等学校经济、管理和应用数学专业师生使用，尤其适合本科高年级和硕士研究生一年级使用。《数理金融学导论》也适合经济和金融专业从业人员阅读。

## 书籍目录

第1章 预备基础1.1 期望效用理论1.1.1 不确定性及与其有关的一些基本概念1.1.2 不确定环境中的偏好分析1.1.3 期望效用函数1.1.4 期望效用分析在金融学中的基本运用1.1.5 期望效用理论的深入讨论1.2 金融市场一般均衡理论1.2.1 金融市场一般均衡的基本概念1.2.2 一般均衡理论与金融市场的价格决定原理1.2.3 金融市场一般均衡分析与资产价值的决定原理1.2.4 金融市场一般均衡模型及其应用1.3 金融最优化方法1.3.1 消费-投资组合最优化模型1.3.2 资产组合的最优化模型及其线性规划方法1.3.3 风险投资的组合与线性规划1.3.4 最小方差投资组合模型及其解法第2章 金融市场与风险理论2.1 现代金融市场理论2.1.1 金融市场的基本概念2.1.2 金融市场结构与效率性2.1.3 金融市场的中介机构2.2 金融风险理论2.2.1 金融市场的风险和回报(收益)2.2.2 风险与收益的分析原理2.2.3 风险的度量原理和基本方法2.2.4 风险资产的市场均衡2.2.5 风险的管理与分散2.3 投资者的风险类型与风险投资原理2.3.1 风险厌恶(风险规避)2.3.2 风险投资的基本原理2.3.3 投资者的风险选择与风险投资最优组合第3章 资产组合理论与投资模型3.1 现代货币金融理论与资产需求原理3.1.1 现代货币需求原理3.1.2 内部货币与外部货币的概念3.1.3 货币的时间价值与金融资产定价3.2 消费-投资组合模型3.2.1 单时期消费-投资组合模型3.2.2 多时期消费-投资组合模型3.3 投资组合的均值-方差分析3.3.1 资产组合的均值-方差分析原理3.3.2 均值-方差组合模型3.3.3 均值-方差组合的均衡分析第4章 资本资产定价与套利定价理论4.1 资产定价理论简述4.1.1 资产组合的一般均衡原理与资产定价4.1.2 基于消费的资本资产定价理论4.1.3 均方差资产定价原理4.2 经典的资本资产定价模型4.2.1 基于消费的CAPM4.2.2 资本资产定价基本模型4.2.3 资本资产定价标准模型4.2.4 CAPM的简单应用4.3 资产定价的动态一般均衡分析4.3.1 离散增长模型4.3.2 资产定价的动态分析原理4.3.3 资产定价的动态一般均衡模型4.4 套利定价模型4.4.1 APT的基本表述4.4.2 APT的具体介绍4.4.3 APT与CAPM的比较4.5 金融市场结构与套利分析4.5.1 APT与有效市场假说理论4.5.2 套利估值与无套利原理第5章 期权与衍生资产定价理论5.1 期权定价理论简述5.1.1 期权定价理论的基本内容和发展5.1.2 期权定价的研究方法5.1.3 期权定价理论的应用5.2 期权、期货及其定价原理5.2.1 有关期权与期货的基本概念5.2.2 期权与衍生资产的价格5.2.3 期货与期货价格5.2.4 卖出-买入期权的平价原则5.3 二叉树模型与期权定价5.3.1 多时期资产选择与二叉树模型5.3.2 二叉树模型5.3.3 二叉树证券价格模型及其特征5.3.4 完备市场上期权定价的二叉树模型5.3.5 二叉树模型在期权价格计算中的基本运用5.4 期权价格的维纳-布朗过程与Black-Scholes定价理论5.4.1 Black-Scholes公式的发展简介5.4.2 期权价格的维纳-布朗过程5.4.3 Black-Scholes公式及其基本性质5.4.4 Black-Scholes公式的简单应用5.5 期权、套利与金融市场的完备性5.5.1 期权与套利行为分析5.5.2 一价律原理与套利5.5.3 套利与金融资产价格第6章 利率与债券定价理论6.1 现代利率理论6.1.1 资金的供给与需求6.1.2 利率的构成及其决定因素6.1.3 利率的功能6.1.4 利率与债券价格之间的关系6.1.5 基于消费的实际利率理论6.2 利率期限结构理论6.2.1 债券的利率期限的基本概念6.2.2 利率期限结构理论的基本内容6.2.3 利率期限结构与市场流动性理论6.3 利率与债券定价6.3.1 利率与债券的收益6.3.2 债券的价值与估价原理6.3.3 债券定价与债券价格分析第7章 公司财务理论7.1 金融市场中的公司财务7.1.1 公司财务决策的内容7.1.2 公司的投资决策7.1.3 非完备市场环境中的公司财务7.2 公司资本结构理论7.2.1 公司资本结构的基本概念7.2.2 公司财务决策与M-M定理7.2.3 政府税收与通过融资创造价值7.3 公司债务定价理论7.3.1 公司债务定价理论及其模型简介7.3.2 未定权益定价理论、模型及其应用简介第8章 行为金融学基础简介8.1 行为金融学简介8.1.1 行为金融学的特征8.1.2 行为金融学的主要内容8.2 期望理论——行为金融学的理论基础和研究方法8.2.1 期望理论的含义8.2.2 期望理论与行为金融学8.2.3 期望理论的基本模型8.3 家庭理财分析8.3.1 生命周期储蓄模型8.3.2 永葆青春模型8.3.3 家庭理财分析举例参考文献

## 编辑推荐

**《数理金融学导论》特色** 《数理金融学导论》是现代金融学数理方法的基础性教材。全书在素材的选取和结构布局方面具有下列特点：结构合理，体系较完整，给出了数理金融学基本框架。从基础这个定位上，《数理金融学导论》内容涵盖了现代金融研究的数理方法和模型、金融实务的数学分析方法、金融学的基本理论和方法论体系。尽可能地简单、直接和易懂。《数理金融学导论》的所有模型和理论都是从经济学和金融学的基础开始，尽量独立分析和推导，而不是从概念、定理、命题出发进行的演绎分析。《数理金融学导论》追求实际背景和原始出处，强调数学模型的来龙去脉，强调对经济与金融原理、思想和问题的深刻理解，强调经济思想与数学思维的结合。《数理金融学导论》用作金融学及相关专业的高年级本科生和研究生学习“数理金融学”课程的教科书。阅读本书只需本科的高等数学、线性代数和基于测度论的数理统计与概率论方面的数学知识。《数理金融学导论》配有教师教学课件，内容包括PPT、习题答案、补充习题等，教师可凭本书最后的教学支持说明页索取。

# 《数理金融学导论》

## 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:[www.tushu111.com](http://www.tushu111.com)