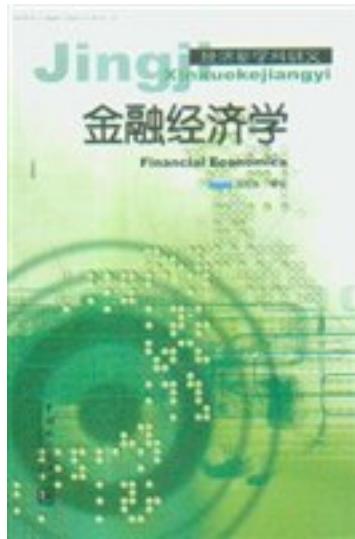


金融经济学



[金融经济学_下载链接1](#)

著者:张连增

出版者:经济管理

出版时间:2006-1

装帧:

isbn:9787802074576

本书内容可分为两部分：无套利理论与方法、利率敏感性金融工业定价。这两部分内容有一些交叉（如在利率敏感性金融工具定价时，无套利假设几乎是一个最基本的假设），但其侧重点不同。

本书包括十章内容，其中前六章内容主要来自《金融经济学》，而后四章内容来自《利率敏感性金融工具评价》。下面简单地加以介绍。

第一章重点对金融市场上的资产与衍生证券作一介绍，另外简单介绍了市场上的利率度量以及比较经典的马可维茨模型。

第二章讨论均衡定价理论，它表明了市场上买卖双方如何通过交易而导致均衡价格。

第三章讨论无套利定价理论，它表明给定原始证券的价格后，衍生证券的价格可表示为关于风险中性概率（或等价鞅测试）的期望

第四章是第三章的具体应用，在本章中一些定理的复杂证明暂时略去。

第五章讨论了利率的期限结构。

第六章是关于连续时间的期权无套利定价问题。

第七章首先总结性地介绍四种类型的利率（即期利率、远期利率、短期利率、满期收益率）及其相互关系，这些不同类型的利率是理解后面各种评价方法的关键。

第八章和第九章分别讨论了利率期限结构的离散时间和单因素模型和连续时间单因素模型。

第十章讨论离散时间模型和连续时间模型的关系。

作者介绍:

目录:

[金融经济学 下载链接1](#)

标签

金融

套利

利率

评论

[金融经济学 下载链接1](#)

书评

[金融经济学 下载链接1](#)