

连续时间金融 (上下册)



连续时间金融 (修订版)

(上)

Continuous-Time Finance
(Revised Edition)

罗伯特·C·默顿 (Robert C. Merton) 著



[连续时间金融 \(上下册\) 下载链接1](#)

著者:罗伯特·C·默顿

出版者:中国人民大学出版社

出版时间:2013-1

装帧:平装

isbn:9787300169491

本书从代理人可以在连续时间中调整其决策这样一个模型出发,发展了金融数学和金融经济理论。本书从头至尾都运用连续时间模型的分析方法,分别阐释了最优消费和投资

组合选择、认股权证和期权定价理论、公司财务和金融中介理论的未定权益分析、金融跨期均衡理论、连续时间模型在某些公共财政问题中的应用。
在本修订版中，新增加了大学捐赠基金管理等内容。保罗·萨缪尔森为本书作序。

作者介绍：

罗伯特·C·默顿 (Robert C. Merton)
)，1997年诺贝尔经济学奖得主。哈佛大学商学院乔治·费雪·贝克尔讲座教授 (George Fisher Baker Professor)，曾担任美国金融协会主席。默顿在期权定价理论和金融工程学上的研究成果极大地促进了全球金融衍生品市场的繁荣。

目录: 第1篇 连续时间模型的金融基础和数学基础

第1章 现代金融学

第2章 投资组合选择和资本市场理论导论：静态分析

第3章 连续时间模型的数学和经济学假设

第2篇 连续时间模型中的最优消费和投资组合选择

第4章 不确定情况下的投资组合选择：连续时间情形

第5章 连续时间模型中的最优消费和投资组合准则

第6章 最优消费理论和投资组合选择的进一步发展

第3篇 认股权证和期权定价理论

第7章 效用最大化的认股权证定价完全模型

第8章 理性期权定价理论

第9章 标的股票收益不连续条件下的期权定价

第10章 期权定价理论的进一步发展

第4篇 公司财务和金融中介理论的未定权益分析

第11章 资产市场的一般均衡模型及其在公司资本结构定价中的应用

第12章 公司债务定价：利率的风险结构

第13章 未定权益定价和莫迪利亚尼米勒定理

第14章 连续时间模型中的金融中介机构

第15章 跨期资本资产定价模型

第16章 连续时间金融的完全市场一般均衡理论

第6篇 连续时间模型在某些公共财政问题中的应用：

长期经济增长、公共养老金计划、存款保险和贷款担保

第17章 不确定条件下增长的渐近理论

第18章 基于消费指数化的公共养老金计划

第19章 存款保险和贷款担保成本的缘由解析：现代期权定价理论的应用

第20章 存在监管成本时的存款保险成本

第21章 大学捐赠基金的最优投资策略

参考文献

· · · · · (收起)

[连续时间金融（上下册）](#) [_下载链接1](#)

标签

金融

金融数学

金融学-金融数学

经济金融

经济

诺贝尔经济学奖

美国

经济学

评论

看本书要求极高的数学水平

说是教材，其实基本来源于Merton的一系列论文，当把金融问题拓展到连续情况时，许多问题也随之得到了合理的解释。博资考之前看了这套书，略有帮助。

[连续时间金融（上下册）](#) [下载链接1](#)

书评

如果数学不行，看见一堆方程就头大的人，这本书买来也只能堆在书架上。
就像萨缪尔森所讲：“推荐给具有完美数学背景的人。”
呵呵，这么说吧，本科不是学数学的看这本书基本看不懂。（除非你自学。）

[连续时间金融（上下册）](#) [下载链接1](#)