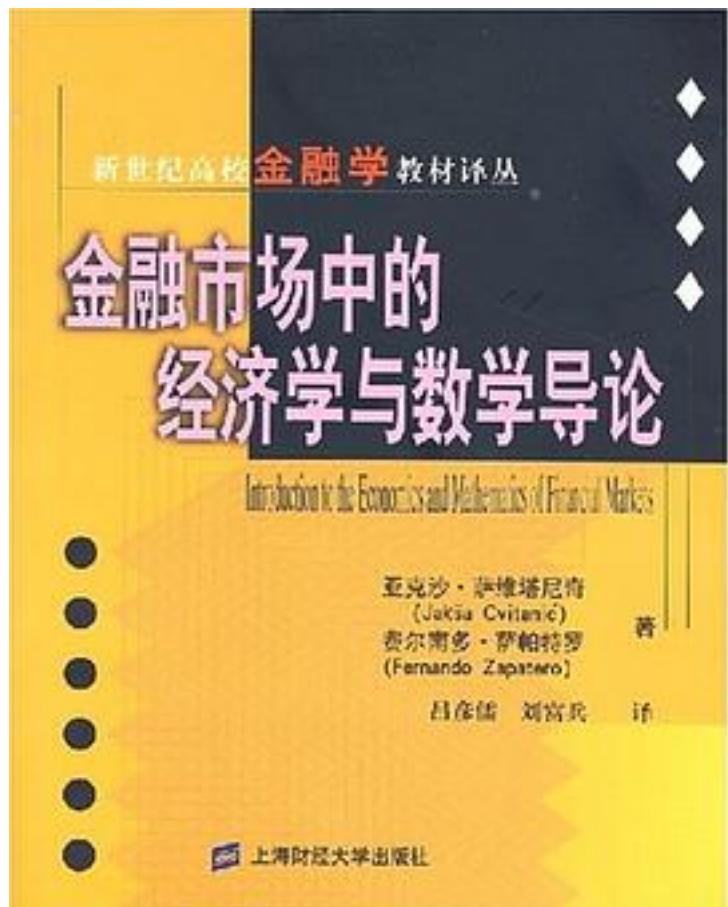


金融市场中的经济学与数学导论



[金融市场中的经济学与数学导论 下载链接1](#)

著者:亚克沙·萨维塔尼奇

出版者:上海财经大学出版社

出版时间:2007-5

装帧:

isbn:9787810988704

本书可以作为金融学、金融经济学、金融工程、数学金融专业的研究生的入门教材。实际上，连续时间部分的内容通常是研究生的读物。我们尽量以直观的形式来解释书中的大多数内容，而一些必要的证明都被留在了各章的附录中。本书并不想和许多优秀的金融数学、金融经济学专业的研究生教材竞争，这些教材一般采用比较正规的数学形式，

是以定理证明的形式编写的，其中很多高级教材在本书的参考文献中都有所提及，它们会为你下一步了解更多高水平的理论方面的内容提供有益的帮助。

作者介绍：

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 期权定价

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

· · · · · (收起)

[金融市场中的经济学与数学导论_下载链接1](#)

标签

经济学

数学

金融数学

金融分析

金融

金融学-金融数学

评论

前9章

很好，很难。

[金融市场中的经济学与数学导论 下载链接1](#)

书评

[金融市场中的经济学与数学导论 下载链接1](#)