

金融决策理论



[金融决策理论 下载链接1](#)

著者:小乔纳森·F·英格索尔

出版者:中国人民大学出版社

出版时间:2009-1

装帧:平装

isbn:9787300097220

《金融决策理论》是在作者讲授的金融课程内容的基础上写成的，其涵盖领域远比一般的论文集或阅读性读物宽泛得多。主要论题包括：风险的含义和度量，一般的单期组合问题，均值一方差分析及资本资产定价模型，套利定价理论，完全市场，多期组合问题和跨期资本资产定价模型，布莱克—斯科尔斯期权定价模型及未定权益分析，鞅及“风险中性”定价，莫迪格里安尼—米勒定理和公司资本结构，利率及期限结构，等等。

作者介绍:

小乔纳森·E·英格索尔，是耶鲁大学管理学院金融学教授，是金融学研究中的顶尖学者。本书是由他在其课程讲义的基础上修改而成的，问世后很快凭借其宽广的覆盖面和透彻的分析深度成为全美大学金融学博士的标准教材或必读著作，出版近20年至今仍跻身于金融学理论的最重要读物之列。

目录: 数学引论

定义和记号

矩阵和线性代数

约束最大化

概率论

第1章 效用理论

1.1 效用函数和偏好顺序

1.2 序数效用函数的性质

1.3 常用序数效用函数的性质

1.4 消费者最优配置问题

1.5 消费需求分析

1.6 求解实例

1.7 期望效用最大化

1.8 基数与序数效用

1.9 独立性公理

1.10 效用独立性

1.11 财富的效用

1.12 风险厌恶

1.13 一些常用的效用函数

1.14 风险厌恶程度比较

1.15 效用函数的高阶微分

1.16 关于有界性的争论：一点经济思想史

1.17 多期效用函数

第2章 套利与资产定价基础

2.1 记号

2.2 多余资产

2.3 未定权益与衍生资产

2.4 可保险状态

2.5 占优和套利

2.6 无套利条件下的定价

2.7 无风险资产的进一步讨论

2.8 无风险套利和市场一价定律

2.9 可能性与概率

2.10 “风险中性”定价

2.11 具有连续状态的经济

第3章 资产组合问题

3.1 规范的组合问题

3.2 最优组合及其定价

3.3 一些简单资产组合的性质

3.4 随机占优

3.5 有效市场理论

3.6 “无风险”经济中的有效市场

3.7 有效市场的信息加总和揭示：一般情形

3.8 有效市场内信息揭示的例子

3.9 共同知识

第4章 均值-方差组合分析

第5章 一般风险、组合选择与资产定价

第6章 组合分离定理

第7章 线性因素模型：套利定价理论

第8章 完全市场均衡模型

第9章 一般均衡与资产定价

第10章 跨期金融模型

第11章 离散时间跨期组合选择

第12章 连续时间金融分布

第13章 连续时间组合选择

第14章 期权定价
第15章 多期模型评述
第16章 随机微分简介
第17章 期权定价高级论题
第18章 利率期限结构
第19章 企业资本结构定价
参考文献
索引
后记

• • • • • ([收起](#))

[金融决策理论_下载链接1](#)

标签

金融

金融学

金融学译丛

金融/投资/CFA

投资

d

评论

难得一笔

1986年的运筹学下金融方面的博士教材，太老啦，材料组织的非常粗糙，利率期限结

构和期权的内容非常老，完全市场资产定价方面的材料组织的非常乱，从各小节题目就可以看出，经济味道，均衡论十分浓。这本书86出版后就没再更新过，就和chifu huang的金融经济学基础一样，出版了就不管了。不要当教材，当参考好点，资产定价的教材cochrance，duffie或者最近新出的都好些，八十年代的书材料太老了。

Yale的Phd讲义，基本是个人都要读。。。Quant可以参考

[金融决策理论_下载链接1](#)

书评

[金融决策理论_下载链接1](#)