

# 《金融投资学与数量经济学若干问题研究》

## 书籍信息

版次：1

页数：

字数：

印刷时间：2013年11月01日

开本：16开

纸张：胶版纸

包装：平装

是否套装：否

国际标准书号ISBN：9787560342627

## 编辑推荐

王雪峰编著的这本《金融投资学与数量经济学若干问题研究》共分10章，内容包括：连续现金流决定的内在价值函数的投资学性质研究；能够反映价格变动幅度差异的股票价格指数编制的新方法；结合成交量指标构建新的股价移动平均线系统；关于布莱克-斯科尔斯期权定价理论的若干探讨；利用生产函数进行经济均衡分析的一些新结果；N-线性计量经济学模型的理论及应用研究；关于一类幂指数求和型生产函数的模型研究；线性计量经济模型参数估计的\*\*相关系数方法；计量经济模型参数估计的\*小变差平方和方法；微分方程半问题理论模型研究及其在经济领域中的应用背景。

## 内容简介

王雪峰编著的这本《金融投资学与数量经济学若干问题研究》的内容是属于金融投资学和数量经济学的。金融投资学方面包括连续现金流的内在价值函数、连续现金流的久期问题和没有正负号限制的连续现金流的投资学问题研究，新的股价指数编制方法，能够反映成交量信息的股价移动平均线系统，股票期权定价公式相关问题研究等内容；数量经济学方面包括结合生产函数的利润\*化法则的数理经济分析方法，N-线性计量经济学模型研究，幂指数求和型生产函数模型研究，线性计量经济学模型的\*相关系数参数估计法，计量经济学模型的最小变差平方和参数估计方法，微分方程半问题模型研究等内容。

《金融投资学与数量经济学若干问题研究》的内容适合作为大专院校经济管理专业师生的参考书。特别地，《金融投资学与数量经济学若干问题研究》适合作为会融专业的研究生、博士生和喜欢金融数学的学生们的参考书。

## 目录

- 第1章 连续现金流决定的内在价值函数的投资学性质研究
  - 1.1 收益率方程决定的资产的内在价值函数及其性质
    - 1.1.1 资产的现金流贴现模型及其各种形式
    - 1.1.2 用函数的观点来考察资产的内在价值
    - 1.1.3 连续形式现金流的收益率方程
    - 1.1.4 由连续现金流的收益率方程推导资产的内在价值函数
    - 1.1.5 连续现金流的内在价值函数的若干性质

- 1.1.6 若干现金收益函数与相应的内在价值函数
- 1.1.7 若干内在价值函数与相应的现金收益函数
- 1.2 连续现金流决定的久期函数的性质
  - 1.2.1 关于离散现金流的久期的回顾与考察
  - 1.2.2 内在价值函数决定的久期函数及其性质
  - 1.2.3 连续现金流的高阶久期和内在价值函数的泰勒展开式
  - 1.2.4 资产组合的久期函数
- 第1章 连续现金流决定的内在价值函数的投资学性质研究
  - 1.1 收益率方程决定的资产的内在价值函数及其性质
    - 1.1.1 资产的现金流贴现模型及其各种形式
    - 1.1.2 用函数的观点来考察资产的内在价值
    - 1.1.3 连续形式现金流的收益率方程
    - 1.1.4 由连续现金流的收益率方程推导资产的内在价值函数
    - 1.1.5 连续现金流的内在价值函数的若干性质
    - 1.1.6 若干现金收益函数与相应的内在价值函数
    - 1.1.7 若干内在价值函数与相应的现金收益函数
  - 1.2 连续现金流决定的久期函数的性质
    - 1.2.1 关于离散现金流的久期的回顾与考察
    - 1.2.2 内在价值函数决定的久期函数及其性质
    - 1.2.3 连续现金流的高阶久期和内在价值函数的泰勒展开式
    - 1.2.4 资产组合的久期函数
    - 1.2.5 久期函数与现金流的关系
    - 1.2.6 若干现金收益函数与相应的内在价值函数和久期函数
  - 1.3 关于没有符号限制的连续现金流的投资学性质研究
    - 1.3.1 没有符号限制的连续现金流的实际背景
    - 1.3.2 连续形式的收益率方程决定的资产的内在价值函数
    - 1.3.3 用内在价值函数判断投资的可行性
    - 1.3.4 一般现金流决定的内在价值函数与贴现率的关系
    - 1.3.5 内在价值为零时资产的特性
    - 1.3.6 一般现金流的久期函数概念的引入及其性质
    - 1.3.7 内在价值函数与久期函数之间的关系
    - 1.3.8 内在价值函数关于贴现率的泰勒展开式和高阶久期
  - 1.4 有待进一步探讨的几个问题
- 第2章 能够反映价格变动幅度差异的股票价格指数编制的新方法
  - 2.1 关于股价指数的已有的编制方法
  - 2.2 关于长期股价指数是否具有纵向可比性的讨论
  - 2.3 关于设计新的股价指数编制方法的设想
  - 2.4 具有异步调整系数的新形式的股价指数公式
  - 2.5 新的股价指数是关于样本股价格的严格单调增函数的证明
  - 2.6 关于新股价指数的其他需要说明的情况
  - 2.7 样本股替换和股票拆细时的指数平稳过渡算法
  - 2.8 总结和建议
- 第3章 结合成交量指标构建新的股价移动平均线系统
  - 3.1 证券的技术分析和移动平均线系统
    - 3.1.1 证券的基本面分析和技术分析概述
    - 3.1.2 证券价格的移动平均线系统和趋势分析
  - 3.2 传统移动平均线理论存在的缺陷
    - 3.2.1 移动平均线的计算只与价格有关
    - 3.2.2 证券价格的趋势分析应该包含成交量的信息
    - 3.2.3 不能反映趋势的价格变化的实例
  - 3.3 基于累积成交量建立新的移动平均线指标体系

3.3.1 构建量价移动平均线的思想来源 3.3.2 固定交易日期间股票成交量的统计特征  
3.3.3 个股的量价移动均线指标的计算公式的导出  
3.3.4 对于大盘的量价移动均线指标的计算公式  
3.4 用量价移动均线进行股价的短期趋势预测  
3.4.1 关于量价移动均线系统的一些理论分析 3.4.2 个股行情的分析  
3.4.3 大盘行情的分析 3.4.4 关于量价移动均线的统计分析结果  
3.4.5 基于量价移动均线的若干操作建议 第4章 关于布莱克-斯科尔斯期权定价理论的若干探讨  
4.1 B-S期权定价理论及其影响 4.2 不符合B-S期权定价理论的一些现象  
4.3 考察在一些极端情况下B-S期权定价模型的偏差  
4.4 合理的期权定价模型的导出 4.5 新的期权定价模型的若干性质及其应用  
4.6 萨缪尔森给出的期权定价理论公式应该是正确的  
第5章 利用生产函数进行经济均衡分析的一些新结果  
5.1 生产函数理论概述和生产函数的各种应用  
5.2 生产函数关于投入要素的边际量的经济意义解释  
5.3 关于利润最大化法则与生产函数相结合的一个问题  
5.4 借助于生产函数表述的利润最大化法则模型  
5.5 用利润最大化法则导出的供给函数和要素需求函数 5.6 新形式的经济均衡模型  
5.7 关于生产函数新探讨的总结 第6章 N-线性计量经济学模型的理论及应用研究  
6.1 关于计量经济学模型的若干研究背景 6.2 N-线性计量经济学理论模型的建立  
6.2.1 N-线性计量经济学模型的思想来源 6.2.2 N-线性计量经济学完备模型的形式及特征  
6.2.3 关于N-线性计量经济学完备模型的插值公式  
6.2.4 N-线性计量经济学模型的改进形式  
6.2.5 部分型N-线性计量经济学模型 6.3 N-线性计量经济学模型若干性质及参数估计  
6.3.1 N-线性计量经济学完备模型及其改进型的若干性质 6.3.2 N-线性计量经济学完备模型及其改进型对样本数据的要求  
6.3.3 N-线性计量经济学完备模型的参数估计方法  
6.3.4 N-线性计量经济学模型改进型的参数估计方法  
6.3.5 N-线性计量经济学完备模型及其改进型的模型参数拟合的评估  
6.4 N-线性计量经济学模型的应用研究  
6.4.1 N-线性计量经济学完备模型拟合效果研究  
6.4.2 N-线性计量经济学模型改进型拟合效果研究  
6.4.3 从超立方体顶点中选取参照点的方案的结果对比  
6.4.4 从样本集合中选取参照点的方案的模型拟合结果对比 6.4.5 N-线性计量经济学模型改进型的应用研究  
第7章 关于一类幂指数求和型生产函数的模型研究  
7.1 已有的各种生产函数模型的形式  
7.1.1 以要素之间替代性质的描述为线索的生产函数的发展  
7.1.2 以技术要素的描述为线索的生产函数模型 7.2 柯布-道格拉斯生产函数模型及其改进型  
7.3 从柯布-道格拉斯生产函数导出幂指数求和型生产函数模型  
7.4 幂指数求和型生产函数的若干性质 7.4.1 MCD生产函数的边际产量  
7.4.2 MCD生产函数的产出弹性系数 7.4.3 MCD生产函数的边际替代率  
7.4.4 MCD生产函数的要素替代弹性 7.4.5 MCD生产函数的规模报酬度量

- 7.4.6 用MCD生产函数测算技术进步
  - 7.4.7 MCD生产函数其他性质
  - 7.4.8 MCD生产函数满足的经济学性质
  - 7.5 关于MCD生产函数的成本函数的若干理论研究
    - 7.5.1 生产函数与成本函数的对偶性
    - 7.5.2 成本函数的概念
    - 7.5.3 若干经典生产函数的成本函数
    - 7.5.4 齐次MCD生产函数的成本函数
    - 7.5.5 MCD生产函数的其他与成本函数相关的性质及产出弹性
    - 7.5.6 基于MCD成本函数的利润分析
    - 7.5.7 MCD生产函数中对  $i+ i$  没有限制的情况的说明
  - 7.6 MCD生产函数的参数估计方法
    - 7.6.1 经典生产函数模型的参数估计方法
    - 7.6.2 MCD生产函数模型对样本数据的要求
    - 7.6.3 MCD生产函数模型参数的最优化模型估计方法
    - 7.6.4 MCD生产函数模型参数的序列线性最小二乘估计方法
  - 7.7 基于我国房地产行业的MCD生产函数实证分析
    - 7.7.1 生产函数样本数据的选取和平均生产函数
    - 7.7.2 使用数据包络分析工具对样本数据进行合理调整
    - 7.7.3 我国房地产业MCD生产函数的参数估计
  - 7.8 基于我国粮食生产的投入产出数据进行MCD生产函数的应用研究
- 第8章 线性计量经济模型参数估计的最大相关系数方法
- 8.1 问题的提出和主要思想
  - 8.2 基于最大相关系数准则的数学模型
  - 8.3 最大相关系数准则的合理性分析
  - 8.4 最大相关系数模型的解所满足的非线性方程组
  - 8.5 用理想样本的计算结果考察最大相关系数模型的适用性
  - 8.6 最大相关系数法估计结果的修正算法
  - 8.7 修正的最大相关系数法的计算实例
  - 8.8 最大相关系数分析法模型应用的步骤
- 第9章 计量经济模型参数估计的最小变差平方和方法
- 9.1 问题的提出和数学模型的设想
  - 9.2 基于最小变差平方和准则的数学模型
  - 9.3 最小变差平方和准则的合理性分析
  - 9.4 最小变差平方和模型的解所满足的线性方程组
  - 9.5 最小变差平方和分析法模型应用的步骤
  - 9.6 用理想样本的计算结果考察最小变差平方和模型的适用性
- 第10章 微分方程半问题理论模型研究及其在经济领域中的应用背景
- 10.1 微分方程模型及其在经济研究领域中的应用
  - 10.2 样本数据普遍具有的离散特性和微分方程半问题
  - 10.3 微分方程半问题模型的数学表述
    - 10.3.1 一阶常微分方程半问题模型
    - 10.3.2 二阶常微分方程半问题模型
    - 10.3.3 一阶偏微分方程半问题模型
    - 10.3.4 二阶偏微分方程半问题模型
    - 10.3.5 一阶常微分方程组半问题模型
  - 10.4 微分方程半问题模型的求解方法
    - 10.4.1 一阶常微分方程半问题模型的求解方法
    - 10.4.2 二阶常微分方程半问题模型的求解方法
    - 10.4.3 一阶偏微分方程半问题模型的求解方法
    - 10.4.4 二阶偏微分方程半问题模型的求解方法
    - 10.4.5 一阶常微分方程组半问题模型的求解方法
  - 10.5 微分方程半问题模型应用的一般步骤
  - 10.6 一个完整的微分方程半问题经济模型的应用研究实例

10.7 有待进一步探讨的若干问题 本书作者发表的部分论文和专著  
本书作者学生的部分学位论文

[显示全部信息](#)

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.tushupdf.com](http://www.tushupdf.com)