第七章 金融资产定价

- 第七章 金融资产定价 01
  - 第一节 收益与风险
    - 一、收益率
      - 金融资产的收益与衡量
      - 通货膨胀率与实际收益率
    - 二、风险与风险溢价
      - 风险的衡量
      - 风险溢价
    - 三、投资组合与分散风险
      - 两种风险资产之间的资产配置
      - 多种风险资产的资产配置
      - 无风险资产与风险资产的资产配置
  - 第二节 资产定价模型
    - 一、资本资产定价模型
      - 假设与含义
      - 指数模型
      - 证券市场线
    - 二、因素模型
      - 单因素模型
      - 多因素模型
      - Fama-French三因子模型
    - 三、套利定价理论
      - 套利及套利组合
      - 套利定价模型
      - 套利定价模型与资本资产定价模型的一致性
  - 第三节 证券估值
    - 一、债券估值
      - 收入资本化法
      - 债券的内在价值
        - 零息债券
        - 固定利息债券
        - 永续债券
      - 债券价值的影响因素：贴现率、信用等级、息票率、剩余期限、 税收待遇、含权条款、流动性、通货膨胀
    - 二、股票估值
      - 股票估值概述
      - 股息贴现模型
      - 公司自由现金流模型
      - 财务倍数模型

Presented with xmind

- 第七章 金融资产定价 02
  - 第四节 金融衍生品定价
    - 一、远期与期货的定价
      - 远期价格与远期合约价值
      - 远期价格和期货价格的关系
      - 无套利分析法的基本思路及基本假设
      - 无收益资产远期价格
      - 支付已知现金收益资产的远期价格
      - 支付已知收益率资产的远期价格
    - 二、期权的定价
      - 期权合约的盈亏分布
        - 欧式看涨期权的盈亏分布
        - 欧式看跌期权的盈亏分布
      - 金融期权的价值结构
        - 内在价值
        - 时间价值
      - 影响期权价格的因素
        - 标的资产的市场价格与期权的执行价格
        - 期权的有效期
        - 标的资产价格的波动率
        - 无风险利率
        - 红利支付
      - 布莱克-斯科尔斯期权定价公式
      - 看涨看跌期权平价关系

Presented with xmind