

対象科目：博士後期課程 アセットプライシング

【出題範囲・大項目】

- ・資産価格論(前提項目)：リスク尺度、効用理論、資産需要理論、裁定機会、確率的割引ファクター、離散時間型多期間選択モデル。
- ・資産価格論(均衡アプローチ)：CAPM, C-CAPM, I-CAPM.
- ・資産価格論(裁定アプローチ)：APT, ファクターモデル, オプション価格論、同値マーティンゲール測度。

【参考文献】

Cochrane, J. H., 2005, Asset Pricing, revised ed., Princeton U.P.

Danthine, J-P. and J. B. Donaldson, 2014, Intermediate Financial Theory, Third ed., Academic Press. (祝迫得夫(監訳)、可児滋、佐野三郎、中田勇人(訳)(2007)『現代ファイナンス分析 資産価格理論』、ときわ総合サービス。)