

<<金融数学引论>>

图书基本信息

书名：<<金融数学引论>>

13位ISBN编号：9787030207449

10位ISBN编号：7030207440

出版时间：2008-1

出版时间：科学

作者：Steven Roman

页数：284

字数：324000

译者：邓欣雨

版权说明：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：<http://www.tushu007.com>

<<金融数学引论>>

内容概要

本书介绍投资组合风险管理和期权定价等金融数学的基本知识，主要包括资本资产定价模型(CAPM)、Black-Scholes期权定价模型以及未定权益定价中常用的无套利原理和方法。每章结合实例解释基本概念，并配有一定量的习题。

本书适合作为高等院校数学、金融或经济学专业的高年级本科生或研究生教材，也可作为金融证券类从业人员的参考书。

书籍目录

第1章 概率论1：离散概率引论 1.1 综述 1.2 概率空间 1.3 独立性 1.4 二项式概率 1.5 随机变量 1.6 期望 1.7 方差和标准差 1.8 协方差，相关性和最佳线性估计 练习1第2章 投资组合管理和资本资产定价模型 2.1 投资组合、收益和风险 2.2 两种资产的投资组合 2.3 多资产的投资组合 练习2第3章 期权的背景知识 3.1 股票期权 3.2 期权的用途 3.3 利润曲线和损益曲线 3.4 卖空 练习3第4章 套利 4.1 远期合约的背景知识 4.2 远期合约的定价 4.3 买权和卖权的平价公式 4.4 期权价格 练习4第5章 概率论2：离散概率 5.1 条件概率 5.2 划分和可测性 5.3 代数 5.4 条件期望 5.5 随机过程 5.6 *代数流和鞅 练习5第6章 离散时间定价模型 6.1 模型的假设条件 6.2 正随机变量 6.3 举例说明基本模型 6.4 基本模型 6.5 投资组合和交易策略 6.6 定价问题：未定权益和复制 6.7 套利交易策略 6.8 可容许的套利交易策略 6.9 套利的刻画 6.10 求解鞅测度 练习6第7章 考克斯-罗斯-鲁宾斯坦 (CRR) 模型 7.1 模型 7.2 CRR模型中的鞅测度 7.3 在CRR模型中的定价 7.4 从另一角度看CRR模型与随机游走 练习7第8章 概率论3：连续概率 8.1 一般的概率空间 8.2 \mathbb{R} 上的概率测度 8.3 分布函数 8.4 密度函数 8.5 \mathbb{R} 上概率测度的类型 8.6 随机变量 8.7 正态分布 8.8 依分布收敛第9章 布莱克-舒尔斯期权定价公式第10章 最优停时和美式期权参考答案节选参考文献附录A 在不完全市场中对不可达到的未定权益定价附录B 凸性和分离定理

<<金融数学引论>>

编辑推荐

《金融数学引论》覆盖了金融数学的两大主要领域，其一是投资组合的风险管理，在资本资产定价模型处达到最高点；其二是资产定价理论，在布莱克-舒尔斯期权定价公式处达到最高点。适合数学、金融或者经济系的高年级本科或者低年级研究生阅读。

<<金融数学引论>>

版权说明

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:<http://www.tushu007.com>