

<<金融数学教程>>

图书基本信息

书名：<<金融数学教程>>

13位ISBN编号：9787115148926

10位ISBN编号：7115148929

出版时间：2006-1

出版时间：人民邮电出版社

作者：请买家自查

页数：194

译者：张寄洲等

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>

<<金融数学教程>>

内容概要

本书是金融数学入门教材，含有大量的习题和例子，面向有一定数学基础的读者，书中首先基本离散时间框架描述了一些基本概念，如单时段模型、二项式树、离散参数鞅、布朗运动、随机分析和Black-Scholes模型及定价公式，接着介绍了一些复杂的金融模型和金融产品，最后讨论了金融方面更为高级的话题，如多资产股票模型、带跳的资产价格模型和随机波动率等。

本书适用于相关专业的本科生和研究生课程，也可供相关领域专业人士参考。

作者简介

(英)埃瑟里奇, Alison Etheridge牛津大学Madgalen学院教授。
拥有牛津大学博士学位,并在剑桥大学做博士后研究。
她曾先后任教于加州大学伯克利分校、爱丁堡大学和伦敦大学。
主要研究兴趣是随机过程和偏微分方程及其应用。
除本书外,她还著有Introduction to Superprocesses一书。

书籍目录

第1章 单时段模型引言1.1 金融中的一些定义1.2 远期合约定价1.3 单时段两值模型1.4 三值模型1.5 无套利特征1.6 风险中性概率测试习题第2章 二项式树和离散参数鞅引言2.1 多时段两值模型2.2 美式期权2.3 离散参数鞅和马尔可夫过程2.4 某些重要的鞅定理2.5 二项式表示定理2.6 连续模型预览习题第3章 布朗运动3.1 随机过程的定义3.2 布朗运动的莱维构造3.3 反射原理与尺度变换3.4 连续时间鞅习题第4章 随机分析引言4.1 股票价格不可微4.2 随机积分4.3 伊藤公式4.4 分部积分法和随机富比尼定理4.5 Girsanov定理4.6 布朗鞅表示定理4.7 为何采用几何布朗运动4.8 Feynman-Kac表示定理习题第5章 Black-Scholes模型引言5.1 基本Black-Scholes模型5.2 欧式期权的Black-Scholes定价和对冲5.3 外汇5.4 红利5.5 债券5.6 风险的市场价格习题第6章 具有不同收益的期权引言6.1 具有不连续收益的欧式期权6.2 多阶段期权6.3 回望期权和障碍期权6.4 亚式期权6.5 美式期权习题第7章 更复杂的模型引言7.1 一般股票模型7.2 多股票模型7.3 带跳的资产定价模型7.4 模型误差习题参考书目记号索引

<<金融数学教程>>

编辑推荐

金融为现代数学技术成功地应用于实际问题提供了一个十分生动的例子：金融衍生品定价。
《金融数学教程》可作为金融数学入门教材，含有大量的习题和例子，面向有一定数学基础的读者。

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>