

<<数学金融学>>

图书基本信息

书名：<<数学金融学>>

13位ISBN编号：9787208045736

10位ISBN编号：7208045739

出版时间：2003-1

出版时间：上海人民出版社

作者：雍炯敏

页数：344

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>

<<数学金融学>>

内容概要

本书可以分为三个部分，第一部分包括一至四章，主要介绍数学金融学中的一些基本概念和若干基本思想。

第二部分包括第五章至七章，着重讲述了单时段市场中的两个基本问题：未定权益定价问题和期望效用最优问题。

第三部分包括第八章至十一章，这部分可以称作为“连续理论”。

这一部分在随机微分方程的框架下讨论连续时间证券市场，包括投资组合的自融资性、市场的完备性和无套利性，等价鞅测度、Black-Scholes欧式期权定价公式、美式期权定价、最优投资组合和均值方差问题、利率期限结构，等等。

<<数学金融学>>

书籍目录

总前言前言第一章 引言第二章 远期第三章 期货第四章 期权第五章 单时段证券市场第六章 单时段
费问题第七章 多时段市场问题第八章 连续时间证券市场第九章 未定权益的定价理论第十章 最优证券
合选择问题第十一章 利率期限结构理论附录全书参考文献

<<数学金融学>>

媒体关注与评论

本套教材涉及的领域很宽，其中既有早已被学界认同的国际金融学和货币银行学，也有在我国有待发展的金融市场学、金融工程学、现代投资学、公司财务学、金融经济学和数学金融学。本书主要内容包括了引言、远期、期货、期权、单时段证券市场、单时段投资消费问题、多时段市场问题、连续时间证券市场等。

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>