

<<金融随机分析 (第1卷)>>

图书基本信息

书名：<<金融随机分析 (第1卷)>>

13位ISBN编号：9787506272865

10位ISBN编号：7506272865

出版时间：2007-4

出版时间：Published in China

作者：Steven E. Shreve

页数：187

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>

<<金融随机分析 (第1卷)>>

内容概要

这是一套介绍随机分析在定量经济学领域中应用的著名教材，作者在该领域享有盛誉，全书共他2卷。

第1卷主要包括随机分析基础性知识和离散时间模型，第2卷主要包括连续时间模型和该模型在经济学中的应用，就其内容而言，第2卷有较为实际的可操作性的定量经济学内容，同时也包含了较为完整的随机微分方程理论，本书各章有习题，适用于掌握微积分基础知识的大学高年级本科生和硕士研究生。

<<金融随机分析 (第1卷)>>

书籍目录

1 The Binomial No-Arbitrage Pricing Model 1.1 One-Period Binomial Model 1.2 Multiperiod Binomial Model 1.3 Computational Considerations 1.4 Summary 1.5 Notes 1.6 Exercises 2 Probability Theory on Coin Toss Space 2.1 Finite Probability Spaces 2.2 Random Variables, Distributions, and Expectations 2.3 Conditional Expectations 2.4 Martingales 2.5 Markov Processes 2.6 Summary 2.7 Notes 2.8 Exercises 3 State Prices 3.1 Change of Measure 3.2 Radon-Nikod \sim m Derivative Process 3.3 Capital Asset Pricing Model 3.4 Summary 3.5 Notes 3.6 Exercises 4 American Derivative Securities 4.1 Introduction 4.2 Non-Path-Dependent American Derivatives 4.3 Stopping Times 4.4 General American Derivatives 4.5 American Call Options 4.6 Summary 4.7 Notes 4.8 Exercises 5 Random Walk 5.1 Introduction 5.2 First Passage Times 5.3 Reflection Principle 5.4 Perpetual American Put: An Example 5.5 Summary 5.6 Notes 5.7 Exercises 6 Interest-Rate-Dependent Assets 6.1 Introduction 6.2 Binomial Model for Interest Rates 6.3 Fixed-Income Derivatives 6.4 Forward Measures 6.5 Futures 6.6 Summary 6.7 Notes 6.8 Exercises Proof of Fundamental Properties of Conditional Expectations References Index

<<金融随机分析 (第1卷)>>

编辑推荐

《金融随机分析》(第1卷)是一套介绍随机分析在定量经济学领域中应用的著名教材,作者在该领域享有盛誉。

《金融随机分析(第1卷)》各章有习题,适用于掌握微积分基础知识的大学高年级本科生和硕士研究生。

<<金融随机分析 (第1卷)>>

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>