

<<随机过程及其在金融领域中的应用>>

图书基本信息

书名：<<随机过程及其在金融领域中的应用>>

13位ISBN编号：9787810829571

10位ISBN编号：7810829572

出版时间：2007-4

出版时间：北方交通大学

作者：王军

页数：262

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>

## <<随机过程及其在金融领域中的应用>>

### 内容概要

本书主要包括两部分内容：一部分是概率空间、随机过程的基本概念、Poisson过程、更新过程、Markov链、Brown运动、鞅、随机微分方程等；另一部分是数理金融学的基本概念和基本知识、金融领域中的数学模型、期权定价理论、Black-Scholes公式、随机过程的一些理论在金融领域中的应用等。

本书适用于应用数学、金融（金融工程，金融数学等）、管理科学、经济学，以及高等院校高年级学生与研究生的教学，也可供有关专业技术人员参考。

书籍目录

第1章 金融领域中的数学模型1.1 债券和利率1.2 证券市场和股票的波动1.3 资产组合1.4 期权定价理论和套利定价习题1第2章 概率空间2.1 概率空间与随机变量2.2 随机变量的数学特征2.3 随机向量及其联合分布2.4 条件数学期望2.5 矩母函数和特征函数2.6  $\mathbb{R}$ -域与一般条件数学期望习题2第3章 随机过程3.1 随机过程的基本概念3.2 随机过程的数学特征3.3 离散时间和离散型随机过程3.4 正态随机过程3.5 Poisson过程3.6 平稳随机过程习题3第4章 Poisson过程4.1 齐次Poisson过程到达时间间隔与等待时间的分布4.2 非齐次Poisson过程和复合Poisson过程4.3 年龄与剩余寿命4.4 更新过程习题4第5章 离散参数Markov链第6章 连续时间Markov链第7章 Brown运动第8章 鞅及其应用第9章 随机微分方程及其在金融中的应用部分习题参考答案参考文献

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>