

<<数理金融初步>>

图书基本信息

书名：<<数理金融初步>>

13位ISBN编号：9787111411093

10位ISBN编号：7111411099

出版时间：2013-2

出版时间：机械工业出版社

作者：（美）Sheldon M. Ross

译者：冉启康

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>

<<数理金融初步>>

内容概要

本书基于期权定价全面介绍数理金融学的基本问题，数理推导严密，内容深入浅出，适合受过有限数学训练的专业交易员和高等院校相关专业本科生阅读。

本书清晰简洁地阐述了套利、Black-Scholes期权定价公式、效用函数、最优投资组合选择、资本资产定价模型等知识。

第3版在第2版的基础上新增了布朗运动与几何布朗运动、随机序关系、随机动态规划等内容，并且扩展了每一章的习题和参考文献。

<<数理金融初步>>

作者简介

作者:(美)罗斯 译者:冉启康

书籍目录

译者序 前言 第1章 概率论 1.1 概率和事件 1.2 条件概率 1.3 随机变量及其期望值
1.4 协方差和相关性 1.5 条件期望 1.6 习题 第2章 正态随机变量 2.1 连续型随机变量
2.2 正态随机变量 2.3 正态随机变量的性质 2.4 中心极限定理 2.5 习题
第3章 布朗运动与几何布朗运动 第4章 利率和现值分析 第5章 合约的套利定价 第6章 套利定理
第7章 Black—Scholes公式 第8章 关于期权的其他结果 第9章 期望效用估值法 第10章 随机序关系
第11章 最优化模型 第12章 随机动态规划 第13章 奇异期权 第14章 非几何布朗运动模型 第15章 自回归模型和均值回复索引

<<数理金融初步>>

编辑推荐

《数理金融初步(原书第3版)/华章数学译丛》编著者罗斯。

本书清晰简洁地阐述了数理金融学的基本问题，主要包括套利、Black-Scholes期权定价公式以及效用函数、最优资产组合原理、资产定价模型等知识，并将书中所讨论的问题的经济背景、解决这些问题的数学方法和基本思想系统地展示给读者。

本书内容选择得当、结构安排合理，既适合作为高等院校学生（包括财经类专业及应用数学专业）的教材，同时也适合从事金融工作的人员阅读。

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>