第一图书网, tushu007.com

<<金融数学>>

图书基本信息

书名：<<金融数学>>

13位ISBN编号：9787115142047

10位ISBN编号：7115142041

出版时间：2006-1

出版时间：人民邮电出版社

作者：Martin Baxter

页数：177

译者：叶中行

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

前言

金融数学的工作可以是严格的，也可以是通俗易懂的。
但是正如约翰逊(Johnson)博士指出的，严格的东西未必是通俗易懂的，而通俗易懂的东西未必是严格的。
但是这两方面都是需要的。
金融数学并不容易，但很多市场的实践操作是依据对实际情况的直觉的。
对有经验的实践者，在对已有的合约进行估价时，直觉就够用了，但对创新产品的定价直觉往往是不够的。
初学者、管理者和法则制定者在面对大量文献时，因为得不到基本准则的清晰解释而会手足无措。
这种凭直觉的实践似乎更适合于行业的发展初期，而不适合于衍生产品交易已形成15万亿美元规模的成熟市场。

第一图书网, tushu007.com

内容概要

金融数学的核心内容之一就是衍生产品的定价。
本书涉足隐藏在衍生证券定价、结构和套期保值背后的数学，严格而又通俗。
作者用易于市场实践者理解的方式介绍了新的诸如鞅、测度变换等概念和Heath-Jarrow-Morton模型。
从借助于二叉树的离散时间套期保值开始，进一步推广到连续时间股票模型(包括Black-Scholes模型)。
本书突出了可实践性，包括了股票、货币和利率市场的诸多例子，并提供了基于实际数据绘制的图形。
附录中提供了关于概率和金融概念的术语表。
本书作为金融数学的基础教材，适用于相关专业的本科生和研究生课程。
也可供金融行业的市场实践者、定量分析师和衍生品交易者等相关领域专业人士参考。

作者简介

Martin Baxter供职于野村证券。
曾连续4年任剑桥大学彭布罗克学院的院士，并曾访问大不列颠哥伦比亚大学1年，多次在欧洲和北美的学术和金融机构作特邀报告。
Andrew Rennie毕业于剑桥大学。
现为美林欧洲公司的首席债券分析师。
叶中行，美国Cornell大学博士。
现任上海交通大学理学院副院长，现代金融研究中心副主任，教授，博士生导师。
其研究领域包括应用概率统计、金融数学、信息理论和信息处理、智能计算等。
出版专著和教材5本，在国际和国内重要学术期刊、国际学术会议发表了数十篇论文。

书籍目录

第1章 引言1.1 期望定价1.2 套利定价1.3 从套利到期望第2章　离散过程2.1 二项式分叉模型2.2 二叉树模型2.3 二项式表示定理2.4 对连续模型的启示第3章 连续过程3.1 连续过程3.2 随机积分3.3 微积分3.4 测度变换—C-M-G定理3.5 鞅表示定理3.6 复制策略3.7 Black-Scholes模型3.8 Black-Scholes的应用第4章 市场证券的定价4.1 外汇4.2 股权与红利4.3 债券4.4 风险的市场价格4.5 双重货币工具第5章 利率5.1 利率市场5.2 一个简单模型5.3 单因子HJM模型5.4 短期利率模型5.5 多因子HJM模型5.6 利率产品5.7 多因子模型第6章 更一般的模型6.1 一般股票模型6.2 对数正态模型6.3 多股票模型6.4 计价单位6.5 外国货币利率模型6.6 无套利完备模型附录1 进一步的阅读附录2 记号附录3 习题解答附录4 技术术语词汇索引

编辑推荐

Baxter和Rennie极其出色地将困难而且不那么直观的概念讲述得通俗易懂。
建议那些对现有的定量化金融思维模式有兴趣的读者，如果你还不知道为什么不是鞅就不可交易，那就立即购买这《金融数学：衍生产品定价引论》，一页一页地阅读，或许还要多读几遍。
——泰晤士高教增刊　　《金融数学：衍生产品定价引论》作为金融数学的基础教材，适用于相关专业的本科生和研究生课程．也可供金融行业的市场实践者、定量分析师和衍生品交易者等相关领域专业人士参考。
睿智、优雅、紧凑，为我们带来了一股清新的空气。
这是一本优秀的关于衍生品定价理论的入门之书，应用了现代的概率方法，开金融数学书籍一代风气之先。
——Risk杂志　　总之，Baxter和Rennie清楚地解释了鞅方法的目的，对更现代的数学方法也作了非常清晰的介绍，……他们对这一前沿理论的表述是如此得出色和清晰。
强烈建议读者购买《金融数学：衍生产品定价引论》，仅仅第三章就物有所值。
——英国　　《金融数学：衍生产品定价引论》揭示了隐藏在衍生证券定价、结构和套期保值背后的数学。
作者既有相当深厚的数学功底，又长期在商学院执教。
《金融数学：衍生产品定价引论》精选素材，巧妙地将衍生产品定价的严格数学模型和推导加以简化，并与市场的实际相结合，成就了这本通俗易懂又不失科学性的教材。
《金融数学：衍生产品定价引论》原版自出版以来重印已经超过了11次，非常畅销。
适用于商学院和数学系本科生作为金融数学或金融工程课程的教材，也是金融人员的必备参考书。

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