

<<经济学和金融学中的随机方法>>

图书基本信息

书名：<<经济学和金融学中的随机方法>>

13位ISBN编号：9787208048775

10位ISBN编号：7208048770

出版时间：2004-4

出版时间：上海人民出版社

作者：马利亚里斯

页数：208

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>

## <<经济学和金融学中的随机方法>>

### 内容概要

本书为“现代金融方法论丛书”之一。

随着现代经济学、金融学实证研究的发展，随机方法作为一种数学工具具有越来越重要的应用价值。

本书分为两大部分。

第一部分介绍了随机方法的基础知识，包括鞅方法、随机过程、最优停时、利用韦纳过程中建立不确定性模型等。

第二部分介绍了随机方法在经济学、金融学中的具体应用。

包括期货空价、工作寻求、随机资本理论、随机经济增长、理性预期假设、价格不确定下的竞争、布莱克 - 斯科尔斯期权等价理论等。

本书脉络清晰、重点突出、实用性强，既可作为教学科研的参考书，又可作为工具书，是一部进入经济学、金融学前沿领域的有效指南。



<<经济学和金融学中的随机方法>>

书籍目录

第1章 概率论的若干结论1.1 引言1.2 概率空间1.3 随机变量1.4 数学期望1.5 条件概率1.6 鞅及基应用1.7 随机过程1.8 最优停时1.9 各种应用和习题1.10 进一步的注释和参考第2章 随机微积分2.1 引言2.2 建立不确定性模型2.3 随机积分2.4 Ito引理2.5 例题2.6 随机微分方程2.7 解的性质2.8 点均衡和稳定性2.9 平稳分布的存在性2.10 随机控制2.11 Bismut方法2.12 跳跃过程2.13 最优停时和自由边界问题2.14 各种应用和习题2.15 进一步的注释和参考第3章 在经济学中的应用3.1 引言3.2 不确定性下的新古典经济增长3.3 不确定性下的开放型经济增长3.4 不确定性下的经济增长:解的性质3.5 不确定性下的经济增长:平稳分布3.6 随机Ramsey问题3.7 Bismut论最优增长3.8 理性预期假设.....第4章 在金融学中的应用参考文献作者索引

## <<经济学和金融学中的随机方法>>

### 编辑推荐

《经济学和金融学中的随机方法》脉络清晰、重点突出、实用性强，既可作为教学科研的参考书，又可作为工具书，是一部进入经济学、金融学前沿领域的有效指南。

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>