

<<金融随机分析（共2册）>>

图书基本信息

书名：<<金融随机分析（共2册）>>

13位ISBN编号：9787564202675

10位ISBN编号：756420267X

出版时间：2008-10

出版时间：上海财经大学出版社

作者：史蒂文 E.施里夫

页数：610

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（共2册）>>

前言

本书是Steven E. Shreve所著Stochastic Calculus for Finance全套两卷的中文版。

原著是将随机分析理论运用于数量金融领域的著名教材，上海财经大学一直将其作为金融数学与金融工程专业博士研究生的基本教材。

学生们对原著好评如潮，并纷纷建议出版中译本，以便国内本科生与研究生的学习和理解。

上海财经大学出版社于2007年向Springer购得了该书的中文版权。

受其委托，现将原著第一卷《二叉树资产定价模型》（2005版）和第二卷《连续时间模型》（2004版）一并译成中文。

<<金融随机分析 (共2册) >>

内容概要

全书共分两卷。

第一卷主要包括随机分析的基础性知识以及离散时间模型，利用较简单的离散时间二叉树模型给出了无套利期权定价方法；虽只用到简单的数学，但其中涉及的风险中性定价的概念十分深刻。

第二卷主要介绍连续时间模型及其在金融学中的应用；其中包含了较为实际的、具有很强操作性的定量经济学内容，同时也包含了较为完整的随机分析理论。

全书各章均有评注和习题。

本书适用于计算机科学、金融、数学、物理及统计专业掌握微积分基础知识的大学高年级本科生、研究生以及相关从业人员。

<<金融随机分析（共2册）>>

作者简介

卡耐基·梅隆大学的计算金融MSCF项目是美国金融工程的带头者，历史悠久，在华尔街亦享有盛誉。

本书作者史蒂文·E施里夫（Steven E. Shreve）教授正是本号业的创办人之一，他经常和华尔街大公司的负责人们沟通，了解行业内新的发展趋势以在课程中加以改进，极大地促进了课程的优化。因而，由他所写的《金融随机分析》（第一、二卷）一直是随机分析在数量金融领域应用方面的著名教材，许多世界名校将其作为金融工程专业的必修教材。

<<金融随机分析 (共2册)>>

书籍目录

第一卷 中文版序 英文版序 引言 1 二叉树无套利定价模型 1.1 单时段二叉树模型 1.2 多时段二叉树模型 1.3 模型的计算 1.4 本章小结 1.5 评注 1.6 习题 2 抛掷硬币空间上的概率论 2.1 有限概率空间 2.2 随机变量、分布和期望 2.3 条件期望 2.4 鞅 2.5 马尔可夫过程 2.6 本章小结 2.7 评注 2.8 习题 3 状态价格 3.1 测度变换 3.2 拉东-尼柯迪姆导数过程 3.3 资本资产定价模型 3.4 本章小结 3.5 评注 3.6 习题 4 美式衍生证券 4.1 引言 4.2 非路径依赖美式衍生产品 4.3 停时 4.4 一般美式衍生产品 4.5 美式看涨期权 4.6 本章小结 4.7 评注 4.8 习题 5 随机游动 5.1 引言 5.2 首达时间 5.3 反射原理 5.4 永久美式看跌期权：一个例子 5.5 本章小结 5.6 评注 5.7 习题 6 依赖利率的资产 6.1 引言 6.2 利率二叉树模型 6.3 固定收益衍生产品 6.4 远期测度 6.5 期货 6.6 本章小结 6.7 评注 6.8 习题 附录：条件期望基本性质的证明 参考文献第二卷 1 一般概率论 2 信息和条件期望 3 布朗运动 4 随机分析 5 风险中性定价 6 与偏微分方程的关系 7 奇异期权 8 美式衍生证券 9 计价单位变换 10 期限结构模型 11 跳过程引论 附录A 附录B 附录C 参考文献 译后记

<<金融随机分析 (共2册)>>

章节摘录

插图：

<<金融随机分析（共2册）>>

后记

《金融随机分析》（第一卷和第二卷）中文版问世，将使本书更易为中国学生及实务工作者接受，十分可喜。

在卡耐基·梅隆大学，我有幸认识了许多中国学生。

这些学生中的绝大多数都打算回到他们的祖国，为中国金融市场正在发生的振奋人心的发展效力。衷心希望这些学生以及他们所学过的这些书籍能够有助于中国金融市场增强有效性，从而具备更多、更好的投资机遇。

此时此刻，我以沉重的心情获悉5月12日在中国四川发生的特大地震造成生命财产的巨大损失以及难以想象的灾难。

人性相通，关于灾情的所见所闻，令远离灾区的我们也心痛无比。

<<金融随机分析 (共2册)>>

编辑推荐

《金融随机分析(共2卷)》适用于计算机科学、金融、数学、物理及统计专业掌握微积分基础知识的大学高年级本科生、研究生以及相关从业人员。

《金融随机分析(共2卷)》是“汉译经济学文库”之一，全书分两卷共17个章节，主要对金融随机分析作了介绍，具体内容包括二叉树无套利定价模型、抛掷硬币空间上的概率论、状态价格、美式衍生证券、风险中性定价等。

<<金融随机分析 (共2册)>>

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>