

<<金融数学教程>>

图书基本信息

书名：<<金融数学教程>>

13位ISBN编号：9787115140906

10位ISBN编号：7115140901

出版时间：2006-1

出版时间：人民邮电出版社

作者：埃瑟里奇 (Alison Etheridge)

页数：196

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>

<<金融数学教程>>

内容概要

金融为现代数学技术成功地应用于实际问题提供了一个十分生动的例子：金融衍生品定价。

《金融数学教程(英文版)》可作为金融数学入门教材，含有大量的习题和例子，面向有一定数学基础的读者。

《金融数学教程(英文版)》首先基于离散时间框架介绍了一些基本概念，如二叉树、鞅、布朗运动、随机积分及Black-Scholes期权定价公式，然后介绍了一些复杂的金融模型和金融产品，最后一章则介绍了金融方面更为高级的话题，如带跳的股票价格模型和随机波动率等。

《金融数学教程(英文版)》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，也可供相关领域专业人士参考。

作者简介

Alison Etheridge, 牛津大学Madgalen学院教授。
拥有牛津大学博士学位, 并在剑桥大学做博士后研究。
她曾先后任教于加州大学伯克利分校、爱丁堡大学和伦敦大学。
主要研究兴趣是随机过程和偏微分方程及其应用。
除本书外, 她还著有Introduction to Superprocesses一书。

书籍目录

1	Single period models	1	Summary	11.1	Some definitions from finance	11.2	Pricing a forward	41.3
	The one-step binary model	61.4	A ternary model	81.5	A characterisation of no arbitrage	91.6	The risk-neutral probability measure	13
	Exercises	182	Binomial trees and discrete parameter martingales	21	Summary	212.1	The multiperiod binary model	212.2
	American options	262.3	Discrete parameter martingales and Markov processes	282.4	Some important martingale theorems	382.5	The Binomial Representation Theorem	432.6
	Overture to continuous models	45	Exercises	473	Brownian motion	51	Summary	513.1
	Definition of the process	513.2	Lévy's construction of Brownian motion	563.3	The reflection principle and scaling	593.4	Martingales in continuous time	63
	Exercises	674	Stochastic calculus	71	Summary	714.1	Stock prices are not differentiable	724.2
	Stochastic integration	744.3	It's formula	854.4	Integration by parts and a stochastic Fubini Theorem	934.5	The Girsanov Theorem	964.6
	The Brownian Martingale Representation Theorem	1004.7	Why geometric Brownian motion?	1024.8	The Feynman-Kac representation	102	Exercises	1075
	The Black-Scholes model	112	Summary	1125.1	The basic Black-Scholes model	1125.2	Black-Scholes price and hedge for European options	1185.3
	Foreign exchange	1225.4	Dividends	1265.5	Bonds	1315.6	Market price of risk	132
	Exercises	1346	Different payoffs	139	Summary	1396.1	European options with discontinuous payoffs	1396.2
	Multistage options	1416.3	Lookbacks and barriers	1446.4	Asian options	1496.5	American options	150
	Exercises	1547	Bigger models	159	Summary	1597.1	General stock model	1607.2
	Multiple stock models	1637.3	Asset prices with jumps	1757.4	Model error	181	Exercises	185
	Bibliography	189	Notation	191	Index	193		

<<金融数学教程>>

编辑推荐

诺贝尔经济学奖已经至少3次授予以数学为工具分析金融问题的经济学家。金融数学这门新兴的交叉学科已经成为国际金融界的一枝奇葩。金融数学的发展曾两次引发了“华尔街革命”。今天，金融数学家已经是华尔街最抢手的人才之一。目前国内金融行业最紧缺的就是掌握现代金融衍生工具的应用、能对金融风险做定量分析的、既然懂金融又懂数学的高级复合型人才。

本书是牛津大学金融数学教材，含有大量的习题和例子，面向有一定数学基础的读者。并被斯坦福大学、芝加哥大学、加州大学亚圣迭戈分校等名校选用。书中介绍了一些基本概念和二叉树、鞅、布朗运动、随机积分及Black-Scholes期权定价公式及一些复杂的金融模型和金融产品。

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>