

<<金融学中的数学>>

图书基本信息

书名：<<金融学中的数学>>

13位ISBN编号：9787040192315

10位ISBN编号：7040192314

出版时间：2006-6

出版时间：高等教育出版社

作者：史树中

页数：334

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>

<<金融学中的数学>>

内容概要

本书针对金融学的需要，专门介绍一些在金融学中经常用到。而在通常数学课程中很少提及的数学工具。

全书共分五章：有限维未定权益空间（线性代数）、无限维未定权益空间（泛函分析）、金融中的最优化问题（数学规划）、金融信息结构的数学描述（概率论）、连续时间金融学的数学基础（随机分析）。

每章节都采取先讲数学、后讲金融的形式，使数学与金融有机地结合起来，重点在金融中的应用。

全书自始至终贯穿着如下的基本思想和写作原则：金融学上的目标是为金融资产定价理论提供必要的数学理论和工具；不追求全面的数学系统性；不回避“深奥”的数学，但回避“艰难”的数学；强调学科的发展史。

本书可作为经济学和金融专业的学生作为教材或教学参考书使用。

<<金融学中的数学>>

书籍目录

前言	第一章 有限维未定权益空间	§ 1.1 有限维线性空间	§ 1.1.1 有限维未定权益空间	§ 1.2 一般线性空间的定义、子空间、基和维数	§ 1.2.1 对于有限维未定权益空间的完全市场和不完全市场	§ 1.3 线性函数、线性映射及其矩阵表示	§ 1.3.1 有限维未定权益空间上的线性定价	§ 1.3.2 有限维未定权益空间上的随机折现因子	§ 1.4 双线性函数	§ 1.4.1 证券组合选择问题中的双线性函数	§ 1.5 内积和Euclid空间	§ 1.5.1 作为Euclid空间的未定权益空间	第二章 无限维未定权益空间	§ 2.1 无限维线性空间	§ 2.1.1 金融中的无限维线性空间	§ 2.2 凸集和凸集分离定理	§ 2.2.1 资产定价基本定理与凸集分离定理	§ 2.3 Banach空间及其共轭空间	§ 2.3.1 金融学中的Banach空间及其共轭空间	§ 2.4 赋范线性空间中的Hahn-Banach定理	§ 2.4.1 未定权益Banach空间上的线性定价	§ 2.5 Hilbert空间和正交性	§ 2.5.1 无限维未定权益空间中的随机折现因子理论	§ 2.6 有关选择公理的一些问题的讨论	第三章 金融中的最优化问题	§ 3.1 凸函数及其主要性质	§ 3.1.1 经济学和金融学中的函数凸性	§ 3.2 最优化问题和Kuhn-, rucker条件	§ 3.2.1 证券组合选择理论中的数学规划	§ 3.2.2 资源最优配置问题和最优投资-消费问题	第四章 金融信息结构的数学描述	§ 4.1 概率论的公理体系	§ 4.1.1 金融的有效市场理论	理性预期模型	§ 4.2 随机游走理论	§ 4.2.1 随机游走与有效市场理论	§ 4.2.2 Black Scholes期权定价公式的二叉树方法	§ 4.3 离散代数流与鞅	§ 4.3.1 多期证券市场模型和有限状态下的资产定价基本定理	§ 4.3.2 无限状态下的资产定价基本定理	第五章 连续时间金融学的数学基础	§ 5.1 作为随机游走连续化的Brown运动	§ 5.1.1 Black Scholes公式的原始推导	§ 5.1.2 利率期限结构的随机微分方程	§ 5.2 连续时间的金融市场模型和资产定价基本定理	参考文献	名词索引	后记
----	---------------	---------------	-------------------	--------------------------	--------------------------------	-----------------------	-------------------------	---------------------------	-------------	-------------------------	-------------------	---------------------------	---------------	---------------	---------------------	-----------------	-------------------------	----------------------	-----------------------------	-----------------------------	----------------------------	---------------------	-----------------------------	----------------------	---------------	-----------------	-----------------------	-----------------------------	------------------------	----------------------------	-----------------	----------------	-------------------	--------	--------------	---------------------	-----------------------------------	---------------	---------------------------------	------------------------	------------------	-------------------------	------------------------------	-----------------------	----------------------------	------	------	----

<<金融学中的数学>>

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>