

<<数理金融学>>

图书基本信息

书名：<<数理金融学>>

13位ISBN编号：9787300072609

10位ISBN编号：7300072607

出版时间：2007-1

出版单位：人民大学

作者：林清泉

页数：318

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>

## <<数理金融学>>

### 内容概要

随着金融自由化的发展和各国金融管制的不断放松，各种金融产品层出不穷，这就导致现代金融市场的不确定性不断增加。

如何在不确定的环境下使资源得到最优的配置，就成为一个现实的问题。

数理金融学是运用数学工具解决金融问题的基础。

本书介绍了数理金融学的理论基础和近年的发展历程，并对各阶段的理论进行了详细的解析。

金融学研究生核心教材系列是教育部推荐教材。

该套丛书立足于培养国际化人才，是为金融学研究生量身定做的重点教材。

教材主编均系金融学研究与教学一线的学术带头人，有丰富的教学经验和深厚的研究积淀，在本领域内深受同行认可。

## 书籍目录

第1章 金融数学基础 1 微积分基础 2 矩阵与线性规划 3 概论论 小结 思考题第2章 效用函数 1 效用函数和偏好序 2 消费者的配给问题 3 期望效用函数 4 风险厌恶效用函数及常用效用函数 小结 思考题第3章 离散状态的金融市场 1 离散状态金融市场模型 2 离散状态金融市场占优与套利模型 小结 思考题第4章 证券组合问题 1 马克维茨组合理论 2 半方差组合 3 基于效用函数的证券组合 4 随机占优 5 有效市场理论 小结 思考题第5章 资本资产定价模型及其扩展 1 资本资产定价模型 2 存在税收因素影响的CAPM模型 3 不存在无风险资产的CAPM模型 4 时际CAPM模型 5 基于消费的CAPM模型 6 套利定价(多因素)模型(MPM与APT) 小结 思考题第6章 B-S公式及其应用 1 B-S公式的发展历史 2 布莱克-斯科尔斯期权定价公式 3 期权价值的敏感性因素分析 4 B-S偏微分方程的其他论证方法及解法 小结 思考题第7章 金融学数理基础第8章 连续时间金融市场第9章 倒向随机微分方程:投资策略与投资成本的一种描述方法第10章 完备市场、无套利市场和等价鞅测度参考文献

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>