第一图书网, tushu007.com

<<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

出版时间：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

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　证券组织问题　1　马克维茨组合理论　2　半方差合　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

第一图书网, tushu007.com

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