

<<金融随机分析 (第1卷)>>

图书基本信息

书名：<<金融随机分析 (第1卷)>>

13位ISBN编号：9787506272865

10位ISBN编号：7506272865

出版时间：2007-4

出版时间：Published in China

作者：Steven E. Shreve

页数：187

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 (第1卷)>>

### 内容概要

这是一套介绍随机分析在定量经济学领域中应用的著名教材，作者在该领域享有盛誉，全书共他2卷。

第1卷主要包括随机分析基础性知识和离散时间模型，第2卷主要包括连续时间模型和该模型在经济学中的应用，就其内容而言，第2卷有较为实际的可操作性的定量经济学内容，同时也包含了较为完整的随机微分方程理论，本书各章有习题，适用于掌握微积分基础知识的大学高年级本科生和硕士研究生。

书籍目录

1 The Binomial No-Arbitrage Pricing Model1.1 One-Period Binomial Model1.2 Multiperiod Binomial Model1.3 Computational Considerations1.4 Summary1.5 Notes1.6 Exercises2 Probability Theory on Coin Toss Space2.1 Finite Probability Spaces2.2 Random Variables, Distributions, and Expectations2.3 Conditional Expectations2.4 Martingales2.5 Markov Processes2.6 Summary2.7 Notes2.8 Exercises3 State Prices3.1 Change of Measure3.2 Radon-Nikod $\sim$ m Derivative Process3.3 Capital Asset Pricing Model3.4 Summary3.5 Notes3.6 Exercises4 American Derivative Securities4.1 Introduction4.2 Non-Path-Dependent American Derivatives4.3 Stopping Times4.4 General American Derivatives4.5 American Call Options4.6 Summary4.7 Notes4.8 Exercises5 Random Walk5.1 Introduction5.2 First Passage Times5.3 Reflection Principle5.4 Perpetual American Put: An Example5.5 Summary5.6 Notes5.7 Exercises6 Interest-Rate-Dependent Assets6.1 Introduction6.2 Binomial Model for Interest Rates6.3 Fixed-Income Derivatives6.4 Forward Measures6.5 Futures6.6 Summary6.7 Notes6.8 ExercisesProof of Fundamental Properties of Conditional ExpectationsReferencesIndex

<<金融随机分析 (第1卷)>>

编辑推荐

《金融随机分析》(第1卷)是一套介绍随机分析在定量经济学领域中应用的著名教材,作者在该领域享有盛誉。

《金融随机分析(第1卷)》各章有习题,适用于掌握微积分基础知识的大学高年级本科生和硕士研究生。

<<金融随机分析 (第1卷)>>

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>