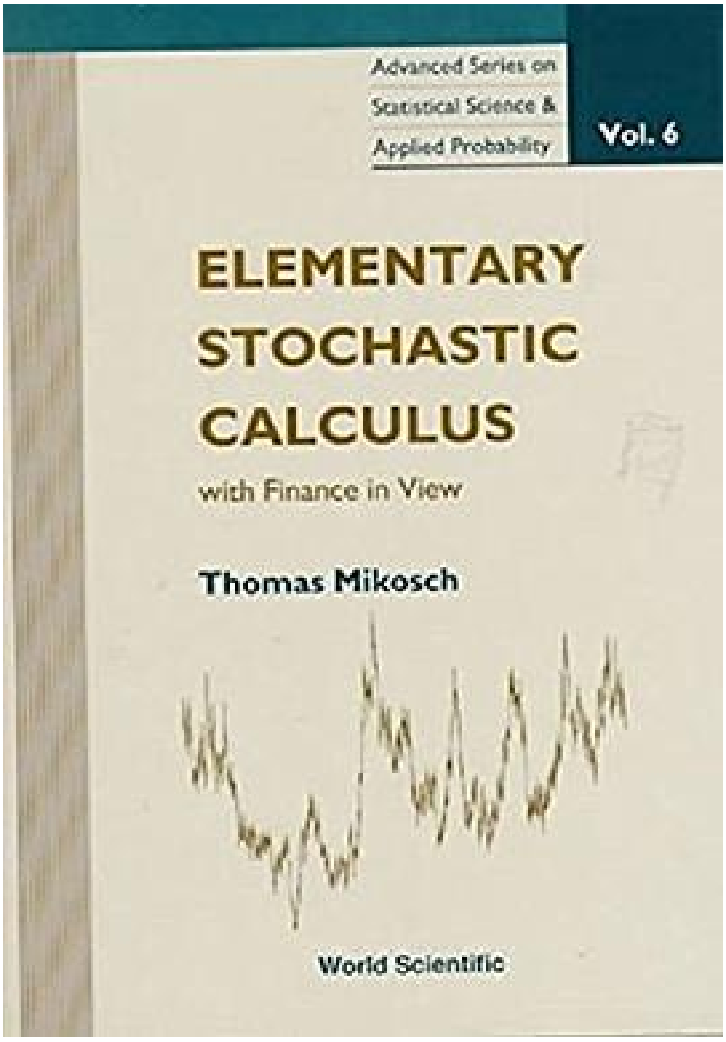
Elementary Stochastic Calculus With Finance in View



[Elementary Stochastic Calculus With Finance in View_下载链接1_]

著者:Thomas Mikosch

出版者:World Scientific Publishing Company

出版时间:1999-10-30

装帧:Hardcover

isbn:9789810235437

Modelling with the Ito integral or stochastic differential equations has become increasingly important in various applied fields, including physics, biology, chemistry and finance. However, stochastic calculus is based on a deep mathematical theory. This text should be suitable for the reader without a deep mathematical background. It seeks to provide an elementary introduction to that area of probability theory, without burdening the reader with a great deal of measure theory. Applications are taken from stochastic finance. In particular, the Black-Scholes option pricing formula is derived.

作者介绍:

目录:

Elementary Stochastic Calculus With Finance in View_下载链接1_

标签

数学

金融

Finance

教材

stochastic

金融数学

随机

概率

评论

从数学角度来看这本书是一星，给四星是因为能把这么深的数学写成一本那么简单的书，能够让那么多人读懂，也算够强大了。。。

我不是学数学出身，不知道要学懂随机分析到底需要多少高深数学；我的研究方向也不是资产定价，只是想了解一点金融数学使用的基本工具是什么样子的。但是通过读这本书，我大概了解了Ito到底想说些什么东西，“鞅”这个东西到底是个什么玩意儿。这本书做到了。拥有一般本科经济类数学功底的都可以读一下。
其中，第一章千万不要忽略，是理解全书的理论基础。张老师用了半学期讲第一章，后面的三章基本上一节课一章了。——因为思想简单，就是背公式而已。

懂了的不用看 不懂的看了也挺迷茫。。

清華經管院的本科生果然生猛，竟然有大二選這門隨機積分課的。

通俗易懂

很好的书 可以用来梳理体系

写得还算清楚、简洁。不过貌似泊松过程只提了一下，做题的时候傻眼了...

虽然据说很简单，可是我还是很纠结……

Soooooooo good! The writing is very conversational. Pointers at all the right places. Read it when you are on the subway or waiting for someone in the coffee shop. You can learn some stochastic calculus in your spare time. How cool is that!

非常适合入门，概念解释的很好，没有很多technique detail不会迷失在公式推导中。

大二下随机过程教材，从第一页精读到最后一页。避开测度论而谈连续时间下的随机分析，侧重于应用。简明，但用于自学较困难

从6本书里选出来的，比较适合我这种不懂measure theory的人，很elementary，适合入门。

BING哥传道的教材

Very easy reading introduction to this subject

Elementary Stochastic Calculus With Finance in View_下载链接1_

书评

我的研究方向不是资产定价，只是想了解一点金融数学使用的基本工具是什么样子的。我更不是学数学出身，不知道要学懂随机分析到底需要多少高深数学。但是通过读这本书，我大概了解Ito（伊藤先生）到底想说些什么东西，“鞅”这个东西到底是个什么玩意儿。这本书做到了。拥有一...

搞不清楚作者的定位是哪一类读者，个人感觉是懂得看了觉得太简单，不懂的看了也不太明白讲什么。整本书比较有点意思的地方时插了不少图（也许是我少见多怪），看过的其他随机分析有关的书中，好像没见过有这么多图的。anyway，这是一本一天内可以看完的书，也许对刚接触布朗运...

Elementary Stochastic Calculus With Finance in View_下载链接1_