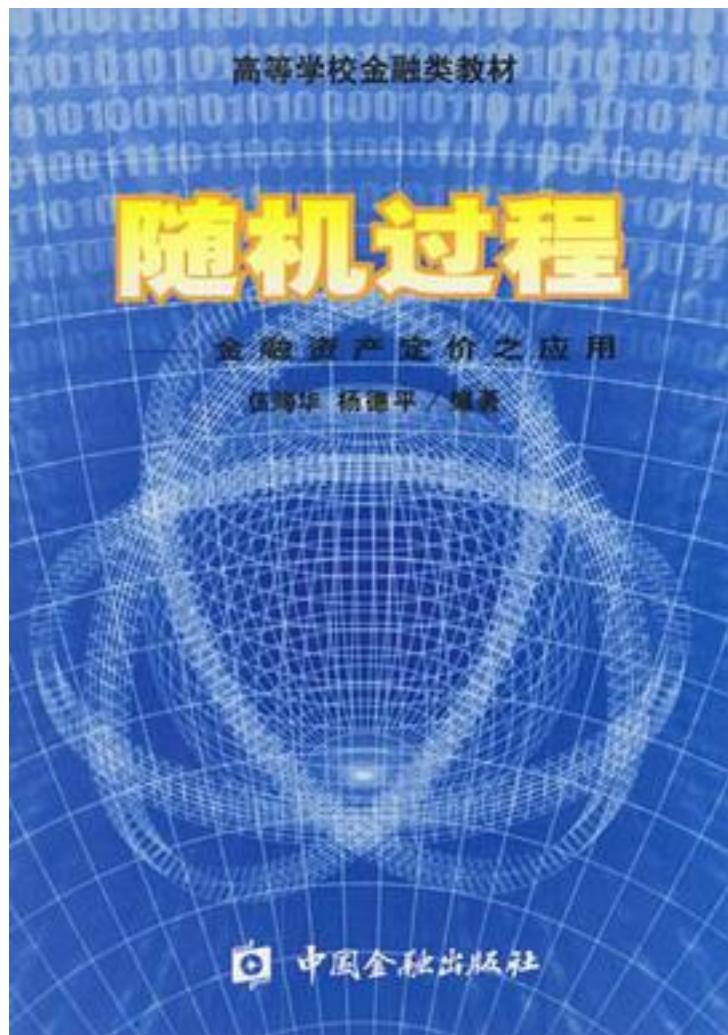


随机过程金融资产定价之应用



[随机过程金融资产定价之应用_下载链接1](#)

著者:伍海华

出版者:中国金融出版社

出版时间:2002-9

装帧:

isbn:9787504927811

《高等学校金融类教材 · 随机过程:金融资产定价之应用》主要内容：在当代学科发展

中，单纯的定性分析已经不能满足科学的研究的发展需要，定量的分析已经越来越显示出其生命力。在经济科学发展中，定性的规范分析与定量的实证研究相结合已经演变成重要的发展方向。而在定量分析中，随机过程理论是研究随机现象规律性的数学分支，已被广泛应用于管理及经济和金融等领域中，并且取得了许多重大的成就。金融领域中的许多现象，如价格的波动、汇率的变化等都满足随机过程的基本特征。因此，作为现代金融经济学理论基石之一的有效市场假定，在某种程度上也是随机过程理论的具体应用。比如说，作为现代金融理论重要工具的鞅和亚鞅理论与有效市场假定有着及其密切的联系，鞅和亚鞅实际上就是定义在价格变化独立基础上的随机过程。

作者介绍:

目录:

[随机过程金融资产定价之应用](#) [下载链接1](#)

标签

评论

[随机过程金融资产定价之应用](#) [下载链接1](#)

书评

[随机过程金融资产定价之应用](#) [下载链接1](#)