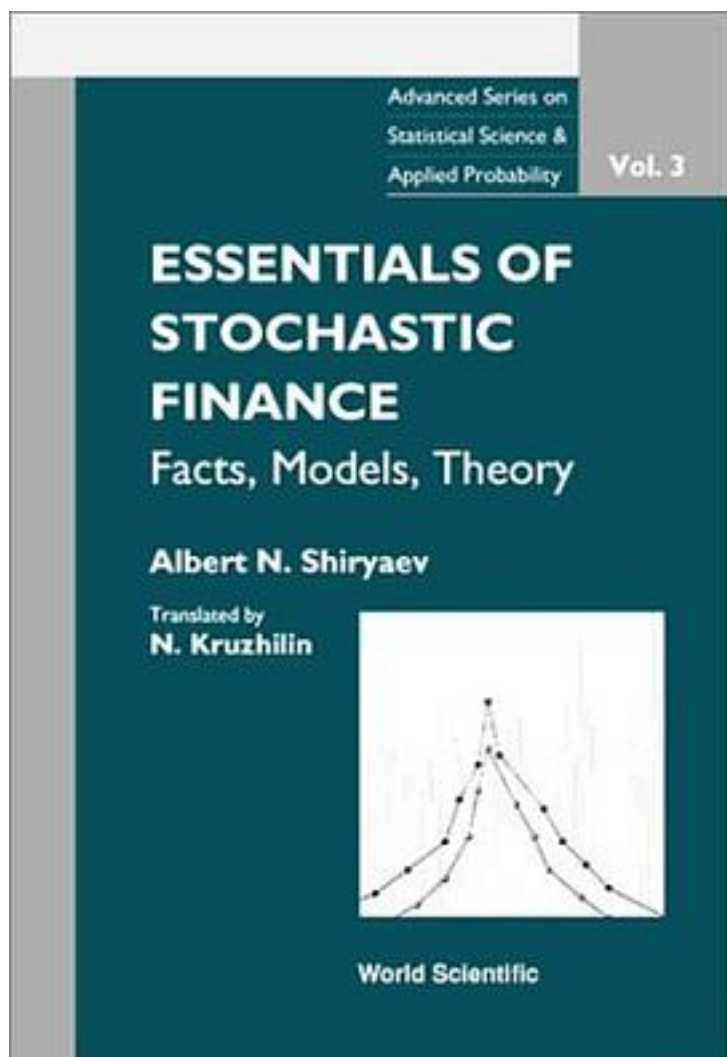


Essentials of Stochastic Finance



[Essentials of Stochastic Finance 下载链接1](#)

著者:Albert N. Shiryaev

出版者:World Scientific Publishing Company

出版时间:1999-4-15

装帧:Hardcover

isbn:9789810236052

This text provides information for those dealing with stochastic calculus and pricing in the models of financial markets operating under uncertainty. It introduces the reader to the main concepts, notions and results of stochastic financial mathematics, and develops applications of these results to various kinds of calculations required in financial engineering. It also answers the requests of teachers of financial mathematics and engineering by making a bias towards probabilistic and statistical ideas and the methods of stochastic calculus in the analysis of market risks.

作者介绍:

A.H.施利亚耶夫，俄罗斯科学院通讯院士，莫斯科大学功勋教授(2004)，莫斯科大学数学-力学系概率论教研室主任(1996)，俄罗斯科学院数学研究所随机过程统计实验室主任(1986)。

施利亚耶夫是现代概率论奠基人、前苏联科学院院士、著名数学家A. H. 柯尔莫戈洛夫的学生。施利亚耶夫的科学活动，涉及概率论和数理统计及其各种不同领域，在概率统计界和金融数学界影响极大。施利亚耶夫出版了18部书，其中7部专著，将近150篇学术论文。

施利亚耶夫的社会科技、国际学术活动非常活跃，多次在重要的国际学术会议上作过学术报告，参与过许多研讨会的组织工作。曾兼职：国际伯努利学会主席(1989—1991)，国际金融数学学会主席(1998—1999)，俄罗斯保险统计员协会主席(1994—1998)，大不列颠皇家统计学会荣誉成员(自1985起)。1990年被选为欧洲科学院院士。

目录:

[Essentials of Stochastic Finance_下载链接1](#)

标签

金融

数学

Shiryaev

Finance

施利亚耶夫

俄罗斯

Mathematics

评论

[Essentials of Stochastic Finance_ 下载链接1](#)

书评

读了一大半，参考系列，感觉没太大收获，可能基础不够，囫圇吞枣。这本书是1995年双曲过程提出者barndorff-nielsen向shiryaev约稿的。书的主体内容是shiryaev在九十年代初访问法国inria金融数学项目，丹麦arhuus大学等形成的，属于作者转行金融数学的一份读书笔记性质的讲义吧...

[Essentials of Stochastic Finance_ 下载链接1](#)