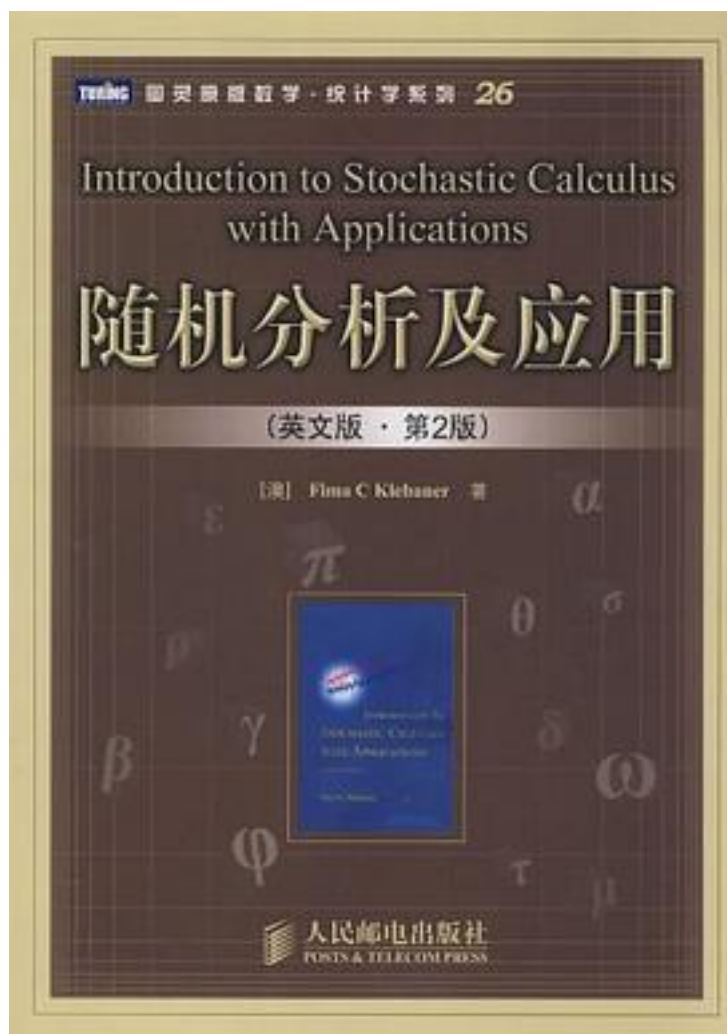


随机分析及应用



[随机分析及应用_下载链接1](#)

著者:克莱巴纳

出版者:人民邮电出版社

出版时间:2008-9

装帧:Paperback

isbn:9787115183446

《随机分析及应用(英文版)(第2版)》介绍了随机分析的理论和应用两方面的知识。内容

涉及积分和概率论的基础知识、基本的随机过程，布朗运动和伊藤过程的积分、随机微分方程、半鞅积分、纯离散过程，以及随机分析在金融、生物、工程和物理等方面的应用。书中有大量的例题和习题，并附有答案，便于读者进行深层次的学习。

《随机分析及应用(英文版)(第2版)》非常适合初学者阅读，可作为高等院校经管、理工和社科类各专业高年级本科生和研究生随机分析和金融数学的教材，也可供相关领域的科研人员参考。

作者介绍:

目录:

[随机分析及应用_下载链接1](#)

标签

数学

概率

随机分析

金融数学

随机分析及应用

随即过程

金融

计量

评论

概念讲的非常清楚，难度正好适合我这小弱。对比之下我校老师出的中文教材简直是勒色

居然一年多前标过这本书，现在再翻一翻满页红黑蓝水笔笔记，居然都没有印象了。都不记得了，这本书打了十几个问号，恐怕再也不会去补出证明过程了。自己脑子不灵光，也不太信随机分析了。

通读，过完全部习题，反正这些概念算是有个印象了，材料还是蛮丰富的，作者也说了对金融工程而言是足够了。第一遍也不用妄图看懂，因为有不少定理都是只给结论没有证明的，需要进阶的话作者都给出了参考书目。这份讲义是个快速入门的导引，如果你想进一步的话。每天三个小时的话看了也有半个月了，不错的书。

强烈推荐此书,此书非常适宜从事金融工程人士阅读，不像数学系，统计系的随机分析这么难,其中很多东西太理论,实际无法在金融衍生物定价中使用，也不像很多金融工程硕士的数学书，难度不够，无法深入阅读复杂的衍生物定价模型，所以这本书的内容可谓正好。推荐大家在学完概率论后阅读，之后研究金融衍生物定价模型就畅通无阻了。

[随机分析及应用_下载链接1](#)

书评

我的随机微积分入门，每一节都很简洁，但是保持了较高的数学逻辑严密性，内容很丰富，包括了最一般的半鞅积分。但是对半鞅积分的论述好像有些逻辑跳跃，而且证明基本只给出个大概思路，我补不上，所以还是选择继续读Protter的《Stochastic Integration and Differential Equati...

[随机分析及应用_下载链接1](#)