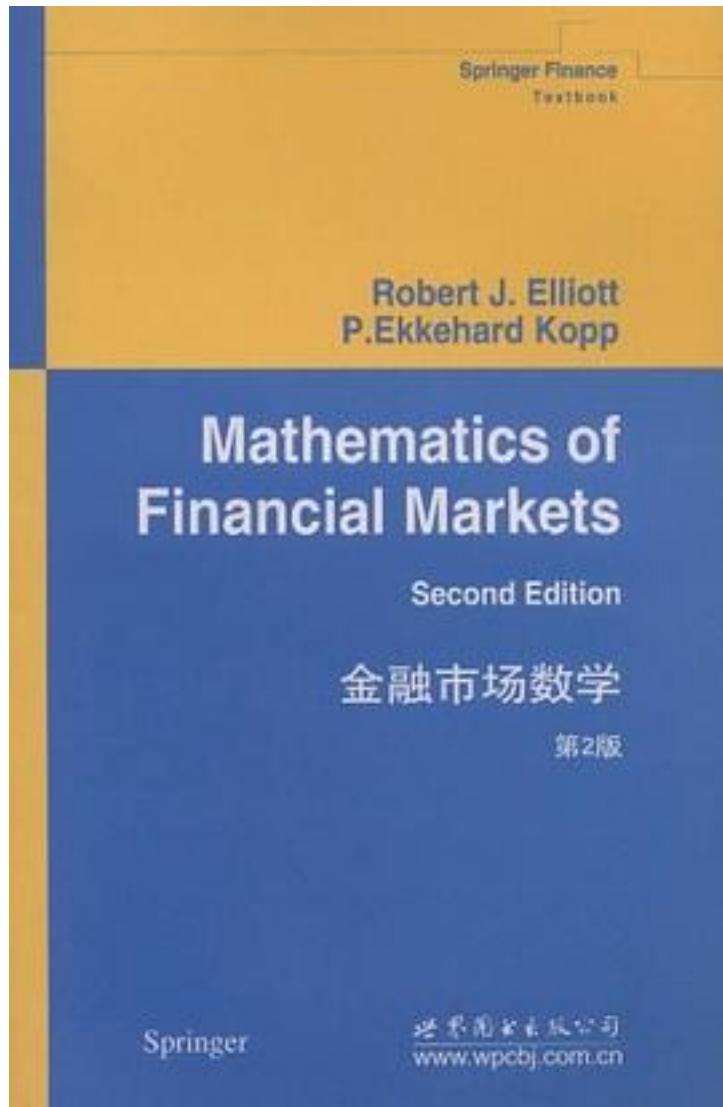


金融市场数学



[金融市场数学 下载链接1](#)

著者: 埃利奥特

出版者:

出版时间: 2010-4

装帧:

isbn: 9787510005671

《金融市场数学(英文)(第2版)》旨在讲述研究现代金融市场衍生证券，如期权、期货和交换业务等所需的数学知识。建立在著名的Black-Scholes理论基础上的理想化连续时间模型需要对现代微积分有较深的了解。然而，书中许多潜在的知识点完全可以在离散时间的框架内理解。是在第1版的基础上做了较多增补，使得连续时间理论应用范围更加广泛，更加详细地介绍Black-Scholes模型及其推广、期限结构和消费投资问题。增加的内容有：一致性风险测度及其在对冲中的应用；一般离散市场模型中资产估价的第一基本定理；不完全离散市场的套利区间；完全离散市场的特征；Black-Scholes模型中的风险、回报和灵敏度。内容安排相当谨慎、详细，而不是泛泛罗列所有尽可能多的内容，对期权的处理相当精辟。通过的学习，读者也可以了解更多的科研动态。目次：套利定价；鞅测度；第一基本定理；完全市场；离散时间美国期权；连续时间随机计算；美国卖方期权；债券和期限结构；消费投资策略；风险度量。

作者介绍：

目录：

[金融市场数学 下载链接1](#)

标签

金融数学

数学

quant

金融

统计

评论

和风险中性定价几乎一模一样。两位作者各有一本鞅论的书，是这本书的主要数学方面的参考书，但那两本书写的比较一般。

复习，这本书就讲完全市场的內容就是泛函啊，第三章最后一节我真的看不下去，krep
s-严加安定理。

为甚麽字那么多啊...

[金融市场数学 下载链接1](#)

书评

[金融市场数学 下载链接1](#)