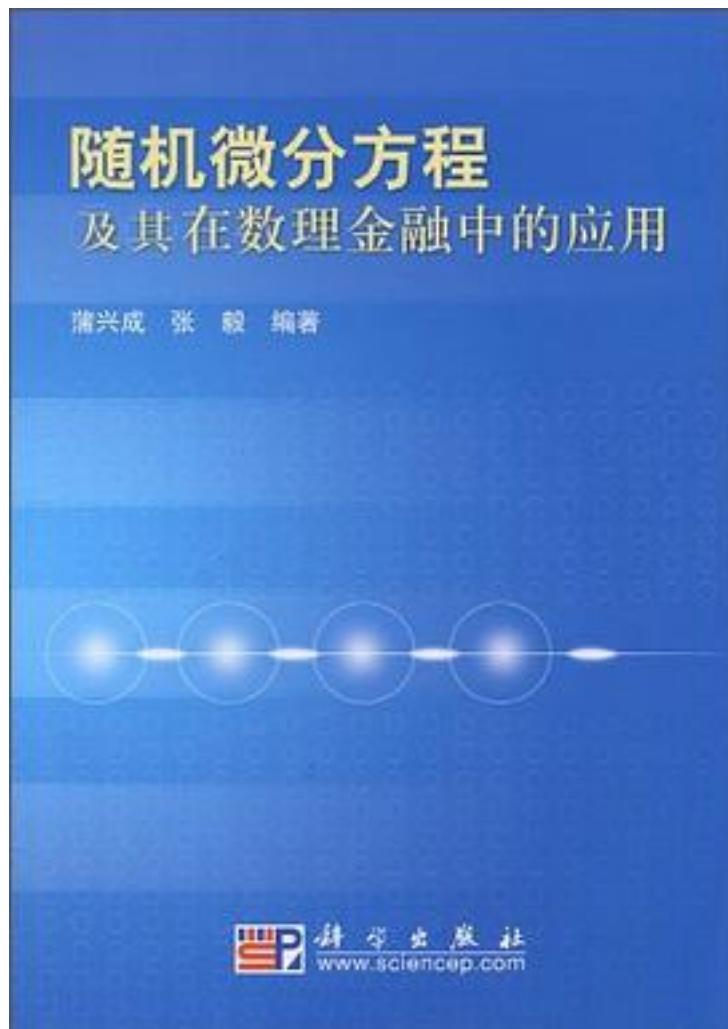


随机微分方程及其在数理金融中的应用



[随机微分方程及其在数理金融中的应用 下载链接1](#)

著者:

出版者:

出版时间:2010-7

装帧:

isbn:9787030282323

《随机微分方程及其在数理金融中的应用》系统介绍了随机微分方程的基础理论，并重

点叙述了随机微分方程在数理金融中的具体应用。前9章主要介绍了布朗运动、Ito积分、随机微分方程解的存在性和唯一性、伊藤分布、扩散理论、随机微分方程在边界值问题和最优停时问题中的应用。后9章主要介绍了非均衡市场中套利选择、市场完备性条件、完备市场下期权定价和套期交易策略的选择Black-Scholes公式及其应用、期权价格的计算、与期权定价密切相关的利率模型、特殊类型的金融模型、Hamilton-Jacobi-Bellman方程与风险投资等金融工程中的一些核心内容。

《随机微分方程及其在数理金融中的应用》可供高等院校本科生、研究生、教师和相关研究单位的科研人员参考

作者介绍:

目录:

[随机微分方程及其在数理金融中的应用 下载链接1](#)

标签

随机微分方程

金融

金融技术

自我管理

基础

1

评论

[随机微分方程及其在数理金融中的应用 下载链接1](#)

书评

[随机微分方程及其在数理金融中的应用 下载链接1](#)