

《金融观点下的随机分析基础》

图书基本信息

书名：《金融观点下的随机分析基础》

13位ISBN编号：978730313638X

作者：Thomas Mikosch

页数：190

译者：王颖喆

版权说明：本站所提供下载的PDF图书仅提供预览和简介以及在线试读，请支持正版图书。

更多资源请访问：www.tushu111.com

《金融观点下的随机分析基础》

内容概要

《新世纪高等学校教材·数学与应用数学系列教材:金融观点下的随机分析基础》由迈克修著。随机分析不仅是数学专业概率方向学生的必修课，也是经济学、金融学某些方向的必修课。有关随机分析的教材很多，大多是英文的。绝大部分随机分析教材对非概率论方向的学生来说是很艰深的，很难读懂。《新世纪高等学校教材·数学与应用数学系列教材:金融观点下的随机分析基础》的英文原著正是基于这一点，对读者数学基础的要求并不是很高，任何一位学过微积分的学生都应该可以读这本书。这是一本理论面向实际的经典教材，基础中有引申，重点面向应用，小巧精制而简洁，没有高深的理论。书中有很多图，直观地解释了随机过程、随机分析中一些晦涩难懂的理论问题。在国内的经济学领域被认为是必读的经典教材。正因为如此，此书获得了广泛的欢迎，原著1998年由world scientific publishing（世界科技出版公司）出版，先后于1999，2000，2003，2004，2006年多次重印，授权世界图书出版公司重印并在中国大陆发行。各大电子商务网站上均有销售，读者评论都很好。目前此书已经有日语的版本了，对于没有较深数学基础的非数学专业的中国学生而言，读一本英文的数学书还是比较困难的，因此急需将其翻译成中文，这样对学生们的学习会有更大的帮助。

《金融观点下的随机分析基础》

书籍目录

目录

第1章 预备知识

1.1 概率论的基本概念

1.1.1 随机变量

1.1.2 随机向量

1.1.3 独立与相关

1.2 随机过程

1.3 布朗运动

1.3.1 定义

1.3.2 由布朗运动导出的过程

1.3.3 布朗运动样本轨道的模拟

1.4 条件期望

1.4.1 离散条件下的条件期望

.....

第2章 随机积分

第3章 随机微分方程

第4章 随机分析在金融领域的英勇

附录

参考文献

索引

符号与缩写

《金融观点下的随机分析基础》

版权说明

本站所提供下载的PDF图书仅提供预览和简介，请支持正版图书。

更多资源请访问:www.tushu111.com