

# 《金融数学(第2版)》

## 图书基本信息

书名：《金融数学(第2版)》

13位ISBN编号：978730017650X

出版时间：2014-5

作者：Marek Capiski, Tomasz Zastawniak

页数：260

译者：郭多祚, 佟孟华

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](http://www.tushu111.com)

# 《金融数学(第2版)》

## 内容概要

马雷克·凯宾斯基、托马斯·札斯特温尼克编著的《金融数学：金融工程引论（第二版）》以债券和股票价格的数学模型为基础，涵盖了对现代金融市场运行有重大影响的数理金融的三个主要领域：离散时间情形和连续时间情形下，基于无套利原则的期权定价；马科维茨投资组合优化和资本资产定价模型；离散情形下的基本随机利率模型。

与第一版相比，本版有以下特点：

第一，每章都以案例分析开始，从而说明实际需要促进了理论工具的发展。

第二，在每章的最后，对事例进行了详细研究。

第三，增加了新的一章用于讨论连续时间模型，根据直觉勾勒出了数学论证和结构。

第四，完全证明了在离散情况下数理金融的两个基本定理。

《金融数学：金融工程引论（第二版）》把金融学动因和数学风格密切结合起来，非常适合管理学、金融学、经济学专业金融数学和金融工程课程使用，同时也是读者进行金融投资活动的绝佳参考书。

# 《金融数学(第2版)》

## 作者简介

马雷克·凯宾斯基，波兰矿业也近学院应用数学系教授，研究领域包括数学金融、公司金融、信贷风险、有价证券、随机分析等。曾出版多本有关金融方面的教材和学术著作，在著名期刊发表论文50多篇。

## 书籍目录

### 第1章 简单市场模型

- 1.1 基本概念和假设
- 1.2 无套利原则
- 1.3 单期二叉树模型
- 1.4 风险和收益
- 1.5 远期合约
- 1.6 看涨期权和看跌期权
- 1.7 外汇
- 1.8 利用期权管理风险

### 第2章 无风险资产

- 2.1 货币的时间价值
- 2.2 货币市场

### 第3章 资产组合管理

- 3.1 风险和收益率
- 3.2 两证券
- 3.3 多个证券
- 3.4 资本资产定价模型

### 第4章 远期合约和期货合约

- 4.1 远期合约
- 4.2 期货合约

### 第5章 期权：一般性质

- 5.1 定义
- 5.2 看跌—看涨期权平价 (Put-Call Parity)
- 5.3 期权价格的边界
- 5.4 决定期权价格的变量
- 5.5 期权的时间价值

### 第6章 二叉树模型

- 6.1 模型的定义
- 6.2 期权定价
- 6.3 美式权益
- 6.4 鞅性质
- 6.5 套期保值

### 第7章 一般的离散时间模型

- 7.1 三叉树模型
- 7.2 一般模型
- 7.3 资产定价基本定理
- 7.4 扩展模型

### 第8章 连续时间模型

- 8.1 离散模型的缺陷
- 8.2 连续时间极限
- 8.3 随机分析概述
- 8.4 在布莱克—斯科尔斯模型中的期权
- 8.5 风险管理

### 第9章 利率

- 9.1 工具
- 9.2 与到期日无关的收益率
- 9.3 一般的期限结构

9.4 随机利率的二叉树模型

9.5 债券的套利定价

9.6 利率衍生证券

9.7 最后的评注

第10章 附录

10.1 微积分

10.2 测度与积分

10.3 概率

10.4 协方差矩阵

10.5 收益率之间的回归

练习解答

符号术语表

参考文献

译后记

# 《金融数学(第2版)》

## 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](http://www.tushu111.com)