

# 《金融衍生工具中的数学》

## 图书基本信息

书名：《金融衍生工具中的数学》

13位ISBN编号：9787810889384

10位ISBN编号：7810889389

出版时间：2008-6

出版社：西南财经大学出版社

作者：Salih N.Nrftci

页数：430

译者：朱波

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.tushu000.com](http://www.tushu000.com)

# 《金融衍生工具中的数学》

## 内容概要

《金融衍生工具中的数学(第2版)》以现代资产定价理论所需的基本数学工具进行了系统全面的介绍，主要内容包括套利定理、风险中性概率、维纳过程、泊松过程、Ito微积分、鞅、偏微分方程、Girsanov定理、Feynman-Kac公式等。该书的一个特色，用简单、清晰的方式将相关数学知识与金融应用很好地结合起来，既为读者弥补了相应数学知识，又能让读者明白这些数学知识在资产定价中是如何应用的。

总的来说，与第一版相比，这一版本的内容几乎增加了一倍。前15章以对印刷和其它错误进行了修订，并新增了几节内容。《金融衍生工具中的数学(第2版)》的新颖之处体现在第二部分的7章内容之中。这几章使用的方法与第一部分类似，涉及固定收益产品和利率产品中的数学工具。最后一章是停时和美式衍生工具的简略介绍。

# 《金融衍生工具中的数学》

## 作者简介

朱波，1977年出生于四川省宣汉县，1995年考入西南师范大学数学系，1999年6月获理学硕士学位，同年9月考入中国社会科学院数量经济技术经济研究所，2005年6月获经济学博士学位。现任职于西南财经大学金融学院，从事金融学的教学和科研工作，主授课程：连续时间金融、资产定价、实证金融、金融随机过程、金融工程、衍生金融工具。研究方向：资产定价、实证金融、金融工程。

# 《金融衍生工具中的数学》

## 书籍目录

第1章 金融衍生工具简介第2章 套利定理基础知识第3章 确定环境和随机环境中的微积分第4章 金融衍生工具定价：模型与记号第5章 概率论中的工具第6章 鞅和鞅表示第7章 随机环境中的微分第8章 维纳过程与金融市场中的稀有事件第9章 随机环境中的积分：Ito积分第10章 Ito引理第11章 衍生资产价格的动态演变：随机微分方程第12章 衍生产品定价：偏微分方程第13章 Black—Scholes PDE应用第14章 衍生产品定价：等价鞅测度第15章 等价鞅测度：应用第16章 利率敏感型证券的新结果和工具第17章 新框架下的套利定理：正规化和随机利率第18章 期限结构建模及相关概念第19章 固定收益证券的经典方法和HJM方法第20章 利率衍生产品的经典PDE分析第21章 条件期望与PDE之间的关系第22章 停时与美式证券参考文献

# 《金融衍生工具中的数学》

## 章节摘录

第1章 金融衍生工具简介 2 定义 用实践者的话来说，“衍生证券就是金融合约，合约的价值可以用现货市场工具如股票、债券、货币和商品等的价格‘推导’出来。”“金融衍生工具”的学术定义要准确得多。 定义：金融合约是在到期日T的价值由T时刻标的现金流工具的市场价格来精确确定的衍生证券或未定权益（Ingersoll,1987）。

# 《金融衍生工具中的数学》

## 精彩短评

- 1、经典书籍，朱波老师的翻译其实挺好的，但印刷错误太多。当然，还是推荐看英文版。
- 2、西南财经引进
- 3、没读完。慢慢读。学数学。
- 4、其实写的还不错。上课没看懂的看书基本都看得懂。。。|期末求包养。。
- 5、四星给原作；一星给译者的努力。  
书中有若干符号错误，但不影响整体学习的流畅性。  
入门的话，看中文版的比直接上手英文更容易坚持看完。  
书中推荐的经典著作很多，但是也都比较老了。
- 6、中文翻译得一塌糊涂 原版就有很多很多细小的错误，计算的错误，公式的错误 没有深入地讲清楚一些原理 但是作为入门教材还是足够了
- 7、应该是我们财大出的这本。
- 8、有点简单了.....

# 《金融衍生工具中的数学》

## 精彩书评

1、1) 翻译跟常见的有区别。2) 很多地方符号错误：140页，假设1： $V > A_1 > 0$  (公式32)，到了假设2： $V < A_2 < 0$  (公式34)，真纠结啊，应该是 $V < A_2 < \text{正无穷大}$ 。3) 很多地方给你很多悬念，然后。。。。。。就没有然后啊。真坑爹啊。不过如果数学功底不好的，就当入门的，翻过一遍好了。

# 《金融衍生工具中的数学》

## 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.tushu000.com](http://www.tushu000.com)