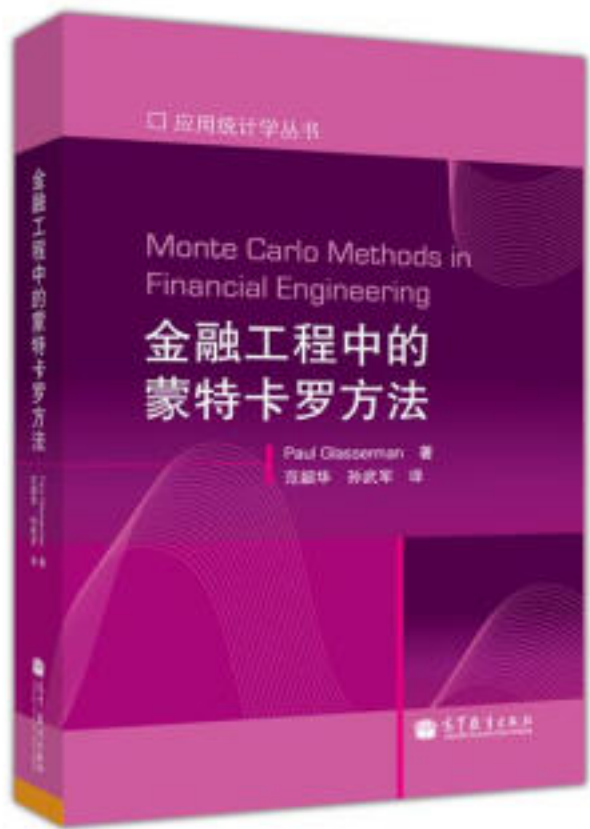


应用统计学丛书：金融工程中的蒙特卡罗方法

[Monte Carlo Methods in Financial Engineering]



[应用统计学丛书：金融工程中的蒙特卡罗方法 \[Monte Carlo Methods in Financial Engineering\]](#) [下载链接1](#)

著者:[美] 格拉瑟曼（Paul Glasserman） 著，范韶华，孙武军 译

[应用统计学丛书：金融工程中的蒙特卡罗方法 \[Monte Carlo Methods in Financial Engineering\]](#) [下载链接1](#)

标签

评论

金工数值方法必看书籍

购物感觉总体不错，送货速度蛮快，商品质量也与描述相符合

东西很不错，老婆很喜欢

以为是本应用书，买来发现是本纯数学书。

很好很好很好很好很好很好很好

不错~~包装，质量都很好，里面的字很清晰，是正版

正版图书，价格实惠，推荐购买。

书很不错，很新，快递也非常效率。

经典书籍，买来当做参考书的。

很好的理论资料，送货真快

还有看，先买放那，以后慢慢看看

~~为啥没有单独封装，封面全是灰，不开心，包装扣一分~~书本纸张还是棒棒的~内容也是极好的

书脊有一点破损了，自己看不影响，还是满意的

好书好书好书

不买后悔，买了也后悔，看不懂。。

这本书对蒙特卡洛的金融应用讲解非常到位，自己觉得比较好懂

金融工程中的蒙特卡罗方法

应用统计学丛书：金融工程中的蒙特卡罗

还好不错，感觉可以，可以

经典教材！！！！！！！！

非常不错，攒起来用，看看效果再追评！

还可以，书给压折了，希望对书籍的保护再好一些

题目就看着好高大上 研究研究吧 希望有所收获

默默摸摸默默摸摸摸摸摸

商品很不错，包装完整，快递快！

这是一本好书，要好好学习

送货快，书也不错

好书 值得看看 很有帮助

还可以。。。。。。。。

经济演化：探索一般演化范式

送货很快，打折买很实惠

送货很快，商品也很满意。

促销活动还是比较给力的，价格优惠

这本书真的很好，推荐给大家

哈哈哈哈哈好好

教科书的感觉

非常好，verygood

好书！人丑就要多学习！

里面很多印刷错误！ 但好就好在是中文的。

书挺经典 嗯。

读起来好费劲，要有高等数学微积分和概率统计方面的知识

这不写的不错

翻译不是很好，有些句子不通就，整体还行

书本内容翻译不是很好，同时对于原书中存在的错误没有进行进一步探讨和更正，感觉一般

还没看

很一般的书籍，翻译什么的听说也不是全对，所以还是建议中英一起看

很有用

不错。

我喜欢

很好

妇

好

:uxowjfhnjurijak

京东送货速度一级赞，今天下单明天到。书不错，就是我要勤奋点看完书才行。这学期的教科书，买本中文版更加深入理解。

商品是否给力？快分享你的购买心得吧~

刚到还没仔细看，略翻了一下感觉不错

在图书馆借过这本书，感觉十分棒十分棒十分棒！真的帮助很大，金融模拟里面好多都能够用的到

细节看不懂，不过书不错

不错不错不错不错不错

不错，值得购买，学习中！

值得一读！

好书，看不懂目前55556666

是有些脏，明显被压过

不错不错很好，有用，正好用着了

这是一本关于金融数学方面的书籍，我非常喜欢。金融数学（Financial Mathematics），又称分析金融学、数理金融学、数学金融学，是20世纪80年代末、90年代初兴起的数学与金融学的交叉学科。金融数学主要运用现代数学理论和方法(如:随机分析、随机最优控制、组合分析、非线性分析、多元统计分析、数学规划、现代计算方法等)对金融(除银行功能之外,还包括投资、债券、基金、股票、期货、期权等金融工具和市场)的理论和实践进行数量的分析研究。其核心问题是不确定条件下的最优投资策略的选择理论和资产的定价理论。套利,最优和均衡是其中三个主要概念。近二十几年来，金融数学不仅对金融工具的创新和对金融市场的有效运作产生直接的影响，而且对公司的投资决策和对研究开发项目的评估(如实物期权)以及在金融机构的风险管理中得到广泛应用。金融与数学的结合越来越引起国际金融界和数学界的关注。金融数学也已经开始在我国得到了越来越广泛的重视。所以更应鼓励数学系学生去考经济金融研究生；增加经济和金融专业数学内容(而不是减少)，鼓励专家学者“下海”，以形成高素质的新型企业家、银行家集团，为我国的金融体制改革，以及我国金融市场与国际金融市场接轨、参与国际金融市场竟争，做出应有的贡献。

很好。是正版！到货速度还行。

老婆买的专业书，学到老活到老，蒙特卡洛貌似很难啊

这段时间对这类书感兴趣，在看

北大的基础 比清华更加扎实

老师让看的书 有中文的好不用看英文了

good!!!!!!!!!!!!!!!!!!!!!!

不错的，质量挺好，价格实惠。

very good very good

数学基础很重要，高数不过关，勿看！

便宜 质量好 速度快

书中介绍了蒙特卡罗方法在金融中的用途，并且将模拟用作呈现金融工程中模型和思想的工具。本书大致分为三个部分。第一部分介绍了蒙特卡罗方法的基本原理，衍生定价基础以及金融工程中一些最重要模型的实现。第二部分描述了如何改进模拟精确度和效率。最后的第三部分讲述了几个特别的论题：价格敏感度估计，美式期权定价以及金融投资组合中的市场风险和信贷风险评估。

应用统计学丛书：金融工程中的蒙特卡罗方法

以前买过英文版的，终于有中文了

国外的教材，很好，用R实现就更好了

不错的金融数学书，有些难度的

第1天下单第2天收 一般般吧

买不到Monte Carlo Methods in Finance的中文版，先用这个替代下，应该不错

内容不错，介绍得很全面。

书还是不错的，还是值得一读的

讲解很系统，纸质不错

不错，活动时买的，京东图书活动一如既往给力。

没问题,一切正常！送货及时，就是有几件要到外地地调货，耽误时间，而且书有一点破

好~~~~~
~~~~~

-----  
送货速度快，该书还是不错的

-----  
蒙特·卡罗方法（Monte Carlo method），也称统计模拟方法，是二十世纪四十年代中期由于科学技术的发展和电子计算机的发明，而被提出的一种以概率统计理论为指导的一类非常重要的数值计算方法。是指使用随机数（或更常见的伪随机数）来解决很多计算问题的方法。与它对应的是确定性算法。蒙特·卡罗方法在金融工程学，宏观经济学，计算物理学（如粒子输运计算、量子热力学计算、空气动力学计算）等领域应用广泛。

-----  
《应用统计学丛书：金融工程中的蒙特卡罗方法》源于作者在哥伦比亚大学多年教学的讲稿。书中介绍了蒙特卡罗方法在金融中的用途，并且将模拟用作呈现金融工程中模型和思想的工具。《应用统计学丛书：金融工程中的蒙特卡罗方法》大致分为三个部分。第一部分介绍了蒙特卡罗方法的基本原理，衍生定价基础以及金融工程中一些最重要模型的实现。第二部分描述了如何改进模拟精确度和效率。最后的第三部分讲述了几个特别的论题：价格敏感性估计、美式期权定价以及金融投资组合中的市场风险和信贷风险评估。Paul Glasserman，哥伦比亚大学商学院高级副院长、Jack R. Anderson教授，美国联邦储蓄保险公司（FDIC）金融研究中心成员。长期从事风险

管理、衍生证券定价、蒙特卡罗模拟等方向的教学和研究，曾发表许多有影响力的研究论文，并担任著名刊物Management Science、Finance & Stochastics、Mathematica/Finance等的编委。

范韶华，威斯康星大学计算机博士，纽约大学库朗数学研究所金融数学硕士，北京师范大学数学学士。现任芝加哥商品期货交易所集团的量化研究总监。曾任瑞银的前台量化分析师，安永咨询部的资深量化分析师，美国贝尔斯登投资银行（现摩根大通银行）的业务副主管。博士论文为关于图像和动画生成的序贯蒙特卡罗方法的研究，曾发表多篇研究论文。

孙武军，上海交通大学应用数学博士，管理学博士后，现任职于南京大学商学院金融与保险学系，主要研究领域包括金融工程、微观金融、风险管理与保险、保险精算、产业经济与技术看新等。发表多篇学术论文，并担任多家著名学术期刊的匿名审稿人。

第1章 基础 1.1 蒙特卡罗原理 1.1.1 介绍 1.1.2 第一个例子 1.1.3 模拟估计的有效性 1.2 衍生品定价准则 1.2.1 定价和复制 1.2.2 套利和风险中性定价 1.2.3 基准变换 1.2.4 风险的市场价格 第2章 随机数与随机变量的产生 2.1 随机数的产生 2.1.1 一般考虑 2.1.2 线性同余发生器 2.1.3 线性同余发生器的实现 2.1.4 格子结构 2.1.5 组合发生器和其他方法 2.2 一般抽样方法 2.2.1 逆变换方法 2.2.2 接受拒绝方法 2.3 正态随机变量和向量 2.3.1 基本性质 2.3.2 一元正态变量的产生 2.3.3 多维正态（样本）的产生 第3章 构造样本路径 3.1 布朗运动 3.1.1 一维情况 3.1.2 多维情况 3.2 几何布朗运动 3.2.1 基本属性 3.2.2 路径依赖型期权 3.2.3 多维情况 3.3 Gauss短期利率模型 3.3.1 基本模型和模拟 3.3.2 债券价格 3.3.3 多因子模型 3.4 平方根扩散过程 3.4.1 转移密度函数 3.4.2 Gamma分布和Poisson分布的抽样 3.4.3 债券价格 3.4.4 扩展 3.5 带跳跃的过程 3.5.1 一个跳跃扩散模型 3.5.2 纯跳跃过程 3.6 远期利率模型：连续利率 3.6.1 HJM框架 3.6.2 离散漂移项 3.6.3 实现 3.7 远期利率模型：简单利率 3.7.1 LIBOR市场模型动态过程 3.7.2 衍生品定价 …… 第4章 方差缩减技术 第5章 准蒙特卡罗 第6章 离散法 第7章 敏感性估计 第8章 美式期权定价 第9章 在风险管理中的运用 附录A 收敛和置信区间 附录B 随机微积分的结果 附录C 利率期限结构 参考文献 索引

-----  
很不错的参考书，学金融工程的应该了解下

-----  
古人云：“书中自有黄金屋，书中自有颜如玉。”可见，古人对读书的情有独钟。其实，对于任何人而言，读书最大的好处在于：它让求知的人从中获知，让无知的人变得有知。读史蒂芬·霍金的《时间简史》和《果壳中的宇宙》，畅游在粒子、生命和星体的处境中，感受智慧的光泽，犹如攀登高山一样，瞬间眼前呈现出仿佛九叠画屏般的开阔视野。于是，便像李白在诗中所写到的“庐山秀出南斗旁，屏风九叠云锦张，影落明湖青黛光”。

对于坎坷曲折的人生道路而言，读书便是最佳的润滑剂。面对苦难，我们苦闷、彷徨、悲伤、绝望，甚至我们低下了曾经高贵骄傲的头。然而我们可否想到过书籍可以给予我们希望和勇气，将慰藉缓缓注入我们干枯的心田，使黑暗的天空再现光芒？读罗曼·罗兰创作、傅雷先生翻译的《名人传》，让我们从伟人的生涯中汲取生存的力量和战斗的勇气，更让我们明白：唯有真实的苦难，才能驱除罗曼蒂克式幻想的苦难；唯有克服苦难的悲剧，才能帮助我们担当起命运的磨难。读海伦·凯勒一个个真实而感人肺腑的故事，感受遭受不济命运的人所具备的自强不息和从容豁达，从而让我们在并非一帆风顺的人生道路上越走越勇，做命运真正的主宰者。在书籍的带领下，我们不断磨炼自己的意志，而我们的的心灵也将渐渐充实成熟。

读书能够荡涤浮躁的尘埃污秽，过滤出一股沁人心脾的灵新之气，甚至还可以营造出一种超凡脱俗的娴静氛围。读陶渊明的《饮酒》诗，体会“结庐在人境，而无车马喧”那种置身闹市却人静如深潭的境界，感悟作者高深、清高背后所具有的定力和毅力；读世

界经典名著《巴黎圣母院》，让我们看到如此丑陋的卡西莫多却能够拥有善良美丽的心灵、淳朴真诚的品质、平静从容的气质和不卑不亢的风度，他的内心在时间的见证下折射出耀人的光彩，使我们在寻觅美的真谛的同时去追求心灵的高尚与纯洁。读王蒙的《宽容的哲学》、林语堂的《生活的艺术》以及古人流传于世的名言警句，这些都能使我们拥有诚实舍弃虚伪，拥有充实舍弃空虚，拥有踏实舍弃浮躁，平静而坦然地度过每一个晨曦每一个黄昏。

买了[SM]一点都不后悔，很喜欢[ZZ]，书是绝对正版的，纸张都非常好！[BJTJ]识伴随人类成长，人类的成长少不了知识。

从远古开始，人们不断丰富自己的知识：从油灯到电灯到无影灯，从刀剑到枪械到炸弹，从热气球到飞机到火箭……正因人们不断丰富知识,掌握技能,才让人们在自然中生存。我们没有猛犸象的庞大;没有猎豹的速度;没有致命的毒液;没有尖锐的牙齿……是什么让人类得以生存?是知识!枪械让我们驯服野兽;飞机让我们在天空中翱翔;船只让我们在海洋中畅游……话说诸葛亮草船借箭，巧借东风，不过是将知识运用到战略上，其实诸葛亮能观天象，他可以明确地知道什么时候下雾，什么时候刮东风……可见，知识的力量多么伟大!我们用知识挽救生命，用知识治理环境……知识无处不在![SZ]

非常好好好阿红好哈哈非常好好好阿红好哈哈

作者是哥大的 名气很大 不错 很有收获

[ZZ]写的的书都写得很好，[sm]还是朋友推荐我看的，后来就非非常喜欢，他的书了。除了他的书，我和我家小孩还喜欢看郑渊洁、杨红樱、黄晓阳、小桥老树、王永杰、杨其铎、晓玲叮当、方洲，他们的书我觉得都写得很好。[SM]，很值得看，价格也非常便宜，比实体店买便宜好多还省车费。

书的内容直得一读[BJTJ]，阅读了一下，写得很好，[NRJJ]，内容也很丰富。[QY]，一本书多读几次，[SZ]。快递送货也很快。还送货上楼。非常好。

[SM]，超值。买书就来京东商城。价格还比别家便宜，还免邮费不错，速度还真是快而且都是正版书。[BJTJ]，买回来觉得还是非常值的。我喜欢看书，喜欢看各种各样的书，看的很杂，文学名著，流行小说都看，只要作者的文笔不是太差，总能让我从头到脚看完整本书。只不过很多时候是当成故事来看，看完了感叹一番也就丢下了。所在来这里买书是非常明智的。然而，目前社会上还有许多人被一些价值不大的东西所束缚，却自得其乐，还觉得很满足。经过几百年的探索和发展，人们对物质需求已不再迫切，但对于精神自由的需求却无端被抹杀了。总之，我认为现代人最缺乏的就是一种开阔进取，寻找最大自由的精神。

中国人讲“虚实相生，天人合一”的思想，“于空寂处见流行，于流行处见空寂”，从而获得对于“道”的体悟，“唯道集虚”。这在传统的艺术中得到了充分的体现，因此中国古代的绘画，提倡“留白”、“布白”，用空白来表现丰富多彩的想象空间和广博深广的人生意味，体现了包纳万物、吞吐一切的胸襟和情怀。让我得到了一种生活情趣和审美方式，伴着笔墨的清香，细细体味，那自由孤寂的灵魂，高尚清真的人格魅力，在寻求美的道路上指引着我，让我抛弃浮躁的世俗，向美学丛林的深处迈进。合上书，闭上眼，书的余香犹存，而我脑海里浮现的，是一个“皎皎明月，仙仙白云，鸿雁高翔，缀叶如雨”的冲淡清幽境界。愿我们身边多一些主教般光明的使者，有更多人能加入到助人为乐、见义勇为的队伍中来。社会需要这样的人，世界需要这样的人，只有这样我们才能创造我们的生活，[NRJJ]希望下次还呢继续购买这里的书籍，这里的书籍很好，非常的不错，。给我带来了不错的现实享受。希望下次还呢继续购买这里的书籍，这

里的书籍很好，非常的不错，。给我带来了不错的现实享受。  
很好的书籍很好的学习必备佳品，，，，希望宣传能给力的，能越做也好，下次还会在来的额，京东给了我不一样的生活，这本书籍给了我不一样的享受，体会到了购物的乐趣，让我深受体会啊。希望你能越做越好，成长有你有我大家一起来，很好的宝贝。

很复杂，看蒙了。本来准备买一本科普型读物的，结果买了一本专业书。

该书作者是哥大著名教授，利用蒙特卡罗方法来拟合复杂的金融现象。书中介绍了蒙特卡罗方法在金融中的用途，并且将模拟用作呈现金融工程中模型和思想的工具。《应用统计学丛书：金融工程中的蒙特卡罗方法》大致分为三个部分。第一部分介绍了蒙特卡罗方法的基本原理，衍生定价基础以及金融工程中一些最重要模型的实现。第二部分描述了如何改进模拟精确度和效率。最后的第三部分讲述了几个特别的论题：价格敏感性估计、美式期权定价以及金融投资组合中的市场风险和信贷风险评估。这本书被作为蒙特卡罗方法在金融方面应用的标准参考文献。这本书的编排在前几章中没有特别出奇，和大多数书一样，从基本原理讲起，进一步的随机数发生器介绍，方差缩减技术，导数计算。与众不同的是他最后两章，美式期权和风险度量。美式期权部分是格拉斯曼的专长，他浓墨重彩了介绍了3种方法，其中两种貌似是他首创。风险度量部分没看，就不评论了。  
这本书对算法部分的介绍很详尽，所有的算法都以小方框中伪代码的形式给予展示，非常便于查找。

书很不错啊书很不错啊

比當當網慢, 好像書籍都這樣是吧.

- a.至少有40间(套)可供出租的客房；
- b.70%客房的面积(不含卫生间和走廊)不小于20平方米；
- c.装修豪华，有豪华的软垫床、写字台、衣橱及衣架、茶几、座椅或简易沙发、床头柜、床头灯、台灯、落地灯、全身镜、行李架等高级配套家具。室内满铺高级地毯,或为优质木地板等。采用区域照明且目的物照明度良好；
- d.有卫生间，装有高级抽水恭桶、梳妆台(配备面盆、梳妆镜)、浴缸并带淋浴喷头(有单独淋浴间的可以不带淋浴喷头),配有浴帘、晾衣绳。采取有效的防滑措施。卫生间采用豪华建筑材料装修地面、墙面，色调高雅柔和,采用分区照明且目的物照明度良好。有良好的排风系统、110/220V电源插座、电话副机。配有吹风机和体重称。24h供应冷、热水。
- e.有可直接拨通国内和国际长途的电话。电话机旁备有使用说明及市内电话簿；
- f.有彩色电视机、音响设备，并有闭路电视演播系统。播放频道不少于16个,其中有卫星电视节目或自办节目，备有频道指示说明和节目单。播放内容应符合中国政府规定。自办节目至少有2个频道,每日不少于2次播放，晚间结束播放时间不早于凌晨1时；
- g.具备十分有效的防噪音及隔音措施；
- h.有内窗帘及外层遮光窗帘；
- i.有单人间；

j.有套房； k.有至少5个开间的豪华套房；  
l.有残疾人客房,该房间内设备能满足残疾人生活起居的一般要求；  
m.有与饭店本身星级相适应的文具用品。有饭店服务指南、价目表、住宿规章、本市旅游景点介绍、本市旅游交通图、与住店客人相适应的报刊；  
n.卢客房、卫生间每天全面整理1次，每日更换床单及枕套,客用品和消耗品补充齐全，并应客人要求随时进房清扫整理,补充客用品和消耗品；  
o.提供开夜床服务，放置晚安卡、鲜花或赠品；  
p.24h提供冷热饮用水及冰块并免费提供茶叶或咖啡；  
q.客房内设微型酒吧(包括小冰箱),提供充足饮料，并在适当位置放置烈性酒,备有饮酒器具和酒单； r.客人在房间会客，可应要求提供加椅和茶水服务； s.提供叫醒服务；  
t.提供留言服务；  
u.提供衣装干洗、湿洗、熨烫及修补服务,可在24h内交还客人。18h提供加急服务；  
v.有送餐菜单和饮料单，24h提供中西式早餐、正餐送餐服务。送餐菜式品种不少于10种,饮料品种不少于8种，甜食品种不少于6种,有可挂置门外的送餐牌；  
w.提供擦鞋服务。 餐厅及酒吧 a.总餐位数与客房接待能力相适应  
b.有布局合理、装饰豪华的中餐厅。至少能提供2种风味中餐。晚餐结束客人点菜时间不早于22时；  
c.有布局合理、装饰豪华、格调高雅的高级西餐厅，配有专门的西餐房；  
d.有独具特色、格调高雅、位置合理的咖啡厅(简易西餐厅)。能提供自助早餐、西式正餐。咖啡厅(或有一餐厅)营业时间不少于18h并有明确的营业时间；  
e.有适量的宴会单间或小宴会厅。能提供中西式宴会服务；  
f.有位置合理、装饰高雅、具有特色、独立封闭式的酒吧；  
g.餐厅及酒吧的主管、领班和服务员能用流利的英语提供服务。餐厅及酒吧至少能用3种外语(英语为必备语种)提供服务。 厨房  
a.位置合理、布局科学,保证传菜路线短且与其他公共区域交叉；  
b.墙面满铺瓷砖，用防滑材料满铺地面,有吊顶；  
c.冷菜间、面点间独立分隔，有足够的冷气设备。冷菜间内有空气消毒设施；  
d.粗加工间与操作间隔离,操作间温度适宜，冷气供给应比客房更为充足；  
e.有足够的冷库； f.洗碗间位置合理； g.有专门放置临时垃圾的设施并保持其封闭；  
h.厨房与餐厅之间,有起隔音、隔热和隔气味作用的进出分开的弹簧门；  
i.采取有效的消杀蚊蝇、蜂螂等虫害措施。 公共区域  
a.有停车场(地下停车场或停车楼)；  
b.有足够的高质量客用电梯,轿厢装修高雅，并有服务电梯；  
c.有公用电话,并配备市内电话簿； d.有男女分设的公共卫生间；  
e.有商场，出售旅行日常用品、旅游纪念品、工艺品等商品；  
f.有商务中心,代售邮票，代发信件,办理电报、电传、传真、复印、国际长途电话、国内行李托运、冲洗胶卷等。提供打字等服务； g.有医务室；  
h.提供代购交通、影剧、参观等票务服务； i.提供市内观光服务；  
j.有应急供电专用线和应急照明灯。 公共及健康娱乐设施 a.歌舞厅；  
b.卡拉OK厅或KTV房(至少4间) c.游戏机室； d.棋牌室；

印刷很好，内容还没看

支持京东支持京东支持京东支持京东支持京东支持京东支持京东支持京东支持京东支持京东支持  
支持京东支持京东支持京东支持京东支持京东支持京东支持京东支持京东支持京东支持京东支持  
支持京东支持京东支持京东支持京东支持京东支持京东支持京东支持京东支持京东支持京东支持  
支持京东支持京东支持京东支持京东支持京东支持京东支持京东支持京东支持京东支持京东支持  
支持京东支持京东支持京东支持京东支持京东支持京东支持京东支持京东支持京东支持京东支持

[illegible]

[应用统计学丛书：金融工程中的蒙特卡罗方法 \[Monte Carlo Methods in Financial Engineering\]\\_下载链接1\\_](#)

书评

[应用统计学丛书：金融工程中的蒙特卡罗方法 \[Monte Carlo Methods in Financial Engineering\]\\_下载链接1](#)