

# 研究の基礎からファイナンス数学の応用まで

近年、ビジネスに欠かせなくなってきた確率過程の基礎的な知識と、ファイナンス理論への応用についてのわかりやすく役に立つ入門書。確率を学んでこなかった読者も視野に入れ、二項分布やポアソン分布、指数分布、そして正規分布を実感できるように説明。ランダム・ウォークとブラウン運動、中心極限定理などをきちんと説明するなかで伊藤の公式、ブラック・ショールズ方程式まで、ファイナンス理論に有用な諸概念を生きた経済データとグラフを交えて、ていねいに解説している。



カバー装丁：  
戸田ツトム

もやもやしていたものが氷解 川崎市・会社員  
通信工学のツールとして確率過程等を復習して  
おります。他書では確率密度と確率の概念が  
よくつかめませんでした。本書は“確率変数の  
出やすさ”と“区間の積分が確率”の表現で、  
完璧に理解でき、今までもやもやしていたものが  
氷解いたしました。

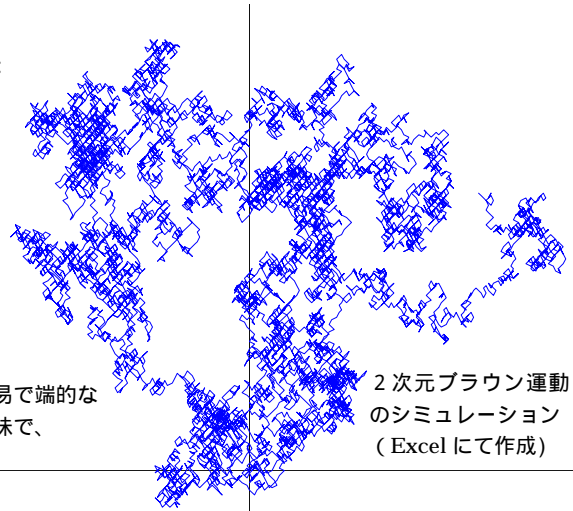
また、本書のように、本質を深く示しながら、平易で端的な  
表現は類書には、見る事ができません。この意味で、  
他の数学分野の出版も期待します。

## [目次]

著者の Web に詳細な目次あり。

URLは <http://www5.ocn.ne.jp/~qmss/>

- 第 1 章 確率の基本
- 第 2 章 確率変数と確率分布
- 第 3 章 いろいろな確率分布
- 第 4 章 多次元確率変数
- 第 5 章 独立確率変数とその応用
- 第 6 章 ランダム・ウォーク
- 第 7 章 極限定理
- 第 8 章 ブラウン運動
- 第 9 章 確率積分と伊藤の公式
- 第 10 章 ファイナンス数理への応用



# 入門 確率過程

松原望 著

A5 判 272 頁 定価 3150 円(税込)  
ISBN4-489-00659-4 C3041

〒112-0005 東京都文京区水道 2-5-22

東京図書株式会社

TEL 03-3814-7818

<http://www.tokyo-tosho.co.jp>