

现代金融方法论丛书

陈工孟 吴冲锋 主编

经济学和金融学中的随机方法

[美] A. G. Malliaris, W. A. Brock 著

陈守东 李小军 李元 译

香港理工大学中国会计与金融研究中心
上海交通大学金融工程研究中心 联合策划

上海人民出版社

责任编辑：

封面装帧：

图书在版编目（CIP）数据

经济学和金融学中的随机方法/陈守东 李小军 李元 译.
—上海：上海人民出版社，2003.3

（现代金融方法论丛书/陈工孟，吴冲锋主编）

ISBN 7 - 208 - 02906 - 7/F • 588

I. 经 … II. 陈 … III. 方法论 - 金融 IV. F832.2

中国版本图书馆 CIP 数据核字（2003）第 33339 号

现代金融方法论丛书

经济学和金融学中的随机方法

陈守东 李小军 李元 译

上海人民出版社出版发行

（版权所有 翻印必究）

（上海绍兴路 54 号 邮政编码 200020）

上海中华印刷厂印刷 各地新华书店经销

开本 850×1168 1/32 印张 14.25 字数 107, 440

2003 年 3 月第 1 版 2003 年 3 月第 1 次印刷

印数：1—3000

ISBN 7 - 208 - 02906 - 7/F • 588

定价：25.00 元

《现代金融方法论丛书》编译委员会

主 编：

陈工孟 香港理工大学中国会计与金融研究中心主任、博导

吴冲锋 上海交通大学金融工程研究中心主任、教授、博导

委 员（以姓氏笔划为序）：

王 江 美国麻省理工学院金融学教授

方兆本 中国科技大学商学院院长、教授、博导

冯宗宪 西安交通大学经济金融学院教授、博导

严加安 中国科学院应用数学研究所院士、研究员、博导

吴世农 厦门大学管理学院副院长、教授、博导

吴冲锋 上海交通大学金融工程研究中心主任、教授、博导

汪寿阳 中国科学院系统科学研究所研究员、教授、博导

陈工孟 香港理工大学中国会计与金融研究中心主任、博导

张 维 天津财经学院副院长、教授、博导

胡汝银 上海证券交易所研究中心总监、教授

胡继之 深圳证券交易所副总经理、高级经济师

裴 平 南京大学商学院金融学系主任、教授、博导

戴国强 上海财经大学金融学院院长、教授、博导

魏国强 香港科技大学财务系教授

总 序

自二十世纪五十年代以来,随着世界经济环境的变化和科学技术的迅猛发展,西方市场经济国家掀起的金融变革和创新热潮,在推动世界各国金融市场和金融产业发展的同时,也为金融经济学的兴起和迅速发展创造了机遇和条件。金融经济学自诞生以来,经过近 50 年的发展,今天已基本形成了一个比较完整的学科体系。随着金融理论研究的进一步深入发展,金融经济学的各种理论和分析方法被广泛应用到社会经济的各个层次中,从资本市场的运作、投资组合的构造、交易策略的选择,到理论假设的检验、分析工具的优化、监管制度的设计等等,几乎渗入了现代经济学的各个领域。正是在这个意义上,金融经济学被美国著名经济学家、诺贝尔经济学奖获得者保罗·萨缪尔森赞誉为“社会科学的珠冠”。

近二十年来,以网络技术为中心的信息革命以及包括中国在内的亚洲新兴证券市场的发展,为金融经济学的各种理论和方法提供了实践运用的崭新机遇。随着资本市场的逐步成熟和繁荣,中国改革开放和经济发展的现实需求,对国内金融领域学术界、实务界和有关财经院校等提出了引入、学习和应用国际前沿金融经济学理论与方法的迫切要求。由于金融经济学领域的研究和分析方法综合了微观经济学、数理统计、计量经济学和几乎所有现代数学学科的知识,因此把国外该领域的经典专著和影响广泛的教材翻译引进国内,作为我们学习和掌握金融经济学理论与方法的开端,这无疑是一个直接而有效的方法。

为了满足国内金融领域学术界和实务界系统学习和掌握现代金融理论及分析方法的迫切需要,同时也为了解决国内金融学、会计学教材尤其是研究生、博士生教材流于零散而不够系统等问题,香港理工大学中国会计与金融研究中心和上海交通大学金融工程研究中心合作,组织国内和香港该领域的专家学者翻译出版了“现代金融方法论丛书”。这套丛书第一批包括《金融数量方法》、《经济学和金融学中的随机方法》、《金融统计方法》、《金融学中的研究和管理科学》等四部书。这套丛书是我们在咨询国外有关专家学者和调查国内学术界和实务界实际需求的基础上,从国外众多教材和专著中精选出来奉献给读者的。我们希望这套丛书的出版,能够有助于中国金融领域学术界和实务界借鉴并吸纳国外先进的研究理念、研究方法,能够为国内该领域的学术研究、学术发展和实务运作提供支持和帮助。

翻译出版这套丛书是一项系统工程,从 2001 年 4 月我们开始策划翻译这套丛书至今,从咨询专家、选择书目、联系版权,到组织翻译、编校书稿、图书出版,从策划者、翻译者到编校者和出版者都投入了大量时间和精力。在选择书目时,我们主要考虑了所选书目要保证理论体系的完整性、涵盖该研究领域最新的发展状况、内容编排体现循序渐进特色、分析方法力求论述详尽便于操作等几个方面。在翻译过程中,为使译文通俗流畅,我们在综合国内外专家学者意见的基础上,对该领域的专有名词的翻译做出了统一规范,为方便读者阅读理解,我们在注重原书完整性的基础上还深入挖掘了相关的背景信息。

由于时间关系,丛书中难免存在不妥和疏漏之处,敬请读者给予批评指正。

陈工孟 吴冲锋

2003 年 1 月