

目次

第Ⅰ部 イン트로ダクション

- 第1章 数学学習の方法論 10
- 第2章 証券アナリストに必要な数学 17
- 第3章 <数学基礎 1>
 $\sqrt{\quad}$ Σ 関数 20

第Ⅱ部 収益率の測定

- 第4章 <統計学基礎 1>
リスクとリターン 31
- 第5章 裁定取引 37
- 第6章 <数学基礎 2>
色々な数列 47
- 第7章 収益率の基礎 52
- 第8章 <数学基礎 3>
対数 61
- 第9章 様々な複利収益率 71
- 第10章 債券の利回り 89
- 第11章 オプション価格 104

第Ⅲ部 ポートフォリオの管理

- 第12章 <統計学基礎 2>
分散と共分散 121
- 第13章 株式ポートフォリオの管理 129
- 第14章 <数学基礎 4>
微分・デュレーション・コンベクシティと
積分 138
- 第15章 債券ポートフォリオの管理 155
- 第16章 <統計学基礎 3>
統計学とポートフォリオ管理 166
- 第17章 <統計学基礎 4>
回帰分析と多変量解析 192
- 第18章 信用リスクモデル 215

付録 1 次レベル過去問名作集 228

さらに勉強するために 242

あとがき 244

練習問題解答 245

索引 283

コラム

裁定取引が苦手な 3 つの理由	4 0
ネーピアとオイラー	6 6
金融電卓とYield Book	7 9
スポットレートとストリップス債	9 4
二項モデルとブラック=ショールズ公式	1 0 7
微積分法の発見者	1 4 5
ギネスビールと t 分布	1 8 0
Data Snooping Bias	1 9 9

コラム 数学の本

藤原正彦『天才の栄光と挫折』	1 4
小平邦彦『ボクは算数しか出来なかった』	2 7
サイモン・シン『フェルマーの最終定理』	5 7
吉田武『オイラーの贈物』	7 0
小川洋子『博士の愛した数式』	1 7 4
藤原正彦『若き数学者のアメリカ』	2 0 9