第一图书网, tushu007.com

<<金融衍生产品的数学模型>>

图书基本信息

书名：<<金融衍生产品的数学模型>>

13位ISBN编号：9787030337054

10位ISBN编号：7030337050

出版时间：2012-4

出版时间：科学出版社

作者：郭宇权

页数：489

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：http://www.tushu007.com

内容概要

金融衍生产品的数学模型是一本关于衍生产品建模理论的教科书，它利用金融工程方法和大多数衍生证券都共同适用的鞅等价原理。
通常在公平和有固定收益市场交易的金融衍生产品，其内容包括定价、对冲和风险管理等方面。
从著名的Black－Scholes－Merton的期权定价模型开始，读者通过本书可看到关于最佳的衍生产品定价模型和利率模型的新进展。
书中详细论述了对求解不同类型的衍生产品定价模型的解析技巧和数值方法。
本书第二版对第一版进行了大量的修订。
在离散时间的框架内，通过对金融经济学原理的分析，使连续时间的鞅定价理论变得生动。
书中收集了各种新型期权和有固定收益的衍生证券闭式解公式。
在本书每章的后面许多最近的研究成果和方法通过习题的方式呈现给读者。
本书对金融市场中标准期权和单资产的Black－Scholes模型推广到新型期权做了相当全面的论述。
通过求解大量习题中所遇到的问题对熟悉的读者来说是一件愉快的事情，而对新学者来说可以从中获得有用的资料。
书中含有大量丰富的内容，例如，障碍期权、巴黎期权、回望期权和亚式期权等。
读者可从中获取关于衍生产品定价的理论和知识。

第一图书网, tushu007.com

<<金融衍生产品的数学模型>>

书籍目录

中文版前言
译者前言
前言
第1章　衍生产品介绍
1．1金融期权及其交易策略
1．1．1关于期权的交易策略
1．2期权价格的合理边界
1．2．1分红的影响
1．2．2看涨一看跌期权的平价关系
1．2．3外汇期权
1．3远期和期货合约
1．3．1远期合约的价值和价格
1．3．2远期和期货价格的关系
1．4互换合约
1．4．1利率互换
1．4．2货币互换
1．5习题
第2章　金融经济学和随机分析
2．1单时段证券模型
2．1．1占优交易策略和线性价格测度
2．1．2套利机会与风险中性概率测度
2．1．3未定权益的价值
2．1．4二叉树期权定价模型的原理
2．2域流、鞅和多时段模型
2．2．1信息结构和域流
2．2．2条件期望与鞅
2．2．3停时和停止过程
2．2．4多时段证券模型
2．2．5多时段二叉树模型
2．3资产价格运动和随机过程
2．3．1随机游动模型
……
第3章　期权定价模型：Black-Scholes-Merton 公式
第4章　路径相关期权
第5章　美式期权
第6章　期权定价的数值方法
第7章　利率模型和债券定价
第8章　利率衍生产品：债券期权、LIBOR及互换产品
参考文献
《现代数学译丛》已出版书目

第一图书网, tushu007.com

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:http://www.tushu007.com