第一图书网, tushu007.com

<<期权定价的数学模型和方法>>

图书基本信息

书名：<<期权定价的数学模型和方法>>

13位ISBN编号：9787040119954

10位ISBN编号：7040119951

出版时间：2003-1

出版时间：高等教育出版社图书发行部（兰色畅想）

作者：姜礼尚

页数：335

字数：370000

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

期权是风险管理的核心工具。
对期权定价理论作出杰出贡献的Scholes和Merton曾因此荣获1997年诺贝尔经济学奖。
　本书从偏微分方程的观点和方法，对Black—Scholes—Merton的期权定价理论作了系统深入的阐述。一方面，从多个角度、多个层面阐明期权定价理论的基本思路；另一方面，充分利用偏微分方程理论和方法对期权理论作深入的定性和定量分析，其中特别对美式期权，与路径有关期权以及隐含波动率等重要问题，展开了深入的讨论。
另外，本书对所涉及的现代数学内容，都有专节介绍，尽可能作到内容是自封的。
　本书可用作应用数学、金融、保险、管理等专业研究生教材，也可供有关领域的研究人员和工作人员参考。

书籍目录

第一章　风险管理与金融衍生物 §1.1　风险和风险管理 §1.2　远期合约与期货 §1.3　期权 §1.4　期权定价 §1.5　交易者的类型第二章　无套利原理 §2.1　金融市场与无套利原理 §2.2　欧式期权定价估计及平价公式 §2.3　美式期权定价估计及提前实施 §2.4　期权定价对敲定价格的依赖关系第三章 期权定价的离散模型——二叉树方法 §3.1　一个例子 §3.2　单时段一双状态模型 §3.3　欧式期权定价的二叉树方法（I）——不支付红利 §3.4　欧式期权定价的二叉树方法（II）——支付红利 §3.5　美式期权定价的二叉树方法 §3.6　美式看涨与看跌期权定价的对称关系式第四章　Brown运动与Ito公式 §4.1　随机游动与Brown运动 §4.2　原生资产价格演化的连续模型 §4.3　二次变差定理 §4.4　Ito积分 §4.5　Ito公式第五章　欧式期权定价——Black.Scholes公式 §5.1　历史回顾 §5.2　Black—Scholes方程　§5.3　Black.Scholes公式　§5.4　Black.Scholes模型的推广（I）——支付红利 §5.5　Black.Scholes模型的推广（II）——两值期权与复合期权　§5.6　数值方法（I）——差分方法　§5.7　数值方法（II）——二叉树方法与差分方法　§5.8　欧式期权价格的性质　§5.9　风险管理第六章　美工期权定价与最佳实施方案第七章　多资产期权第八章　路径有关期权（I）——弱路径有关期权第九章　路径有关期权（II）——强路径有关期权第十章　隐含波动率参考文献名词索引

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