第一图书网, tushu007.com

<<随机利率模型及相关衍生品定价>>

图书基本信息

书名：<<随机利率模型及相关衍生品定价>>

13位ISBN编号：9787310034130

10位ISBN编号：7310034139

出版时间：2010-4

出版时间：南开大学出版社

作者：皮里沃

页数：161

译者：韦晓

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

《随机利率模型及相关衍生品定价》介绍了利率和债券市场的随机模型和相关衍生产品的定价。全书共分十三章：前面两章介绍了随机微积分和关于股票期权的经典Black-Scholes定价理论；第三章简要介绍了短期利率模型；第四章介绍了零息债券的定义和定价；第六章介绍了远期利率建模的随机模型Heath-Jarrow-Morton和相应的无套利条件；第七章介绍了远期测度的构造及其在利率衍生产品的定价中的应用，同时也给出其在债券期权定价中的应用；第八章给出了估计和拟合利率曲线中出现的问题；第九章和第十章分别介绍LIBOR市场和Brace-Gatarek-Musiela（BGM）模型，并给出模型校正的要点。
《随机利率模型及相关衍生品定价》还包括两个附录，附录A是关于数学的准备工具，附录B是关于该领域未来的发展和展望。
每章中附带练习的完整答案在《随机利率模型及相关衍生品定价》的最后部分给出，部分练习是原创的，而另一部分是典型习题。
《随机利率模型及相关衍生品定价》主要针对高年级的本科生和初级阶段的研究生，并假设读者已掌握基本的概率知识。

书籍目录

序言中文版序言第一章　随机微积分的回顾1.1　布朗运动1.2　随机积分1.3　平方变差1.4　伊藤公式1.5　练习第二章　Black.Scholes定价理论的回顾2.1　看涨和看跌期权2.2　市场模型和投资组合2.3　偏微分方程方法2.4　Girsanov定理2.5　鞅方法2.6　练习第三章　短期利率模型3.1　均值回归模型3.2　常数方差弹性（CEV）模型3.3　时间相依模型3.4　练习第四章　零息债券的定价4.1　定义和基本性质4.2　无套利和马氏性4.3　无套利和鞅性4.4　偏微分方程的解：概率方法4.5　偏微分方程的解：分析方法4.6　数值模拟4.7　练习第五章　远期利率模型5.1　远期合约5.2　瞬时远期利率5.3　短期利率5.4　远期利率的参数化5.5　曲线估计5.6　练习第六章　Heath.Jarrow.Morton（HJM）模型6.1　目标重述6.2　远期Vasicek利率6.3　远期即时利率的动态过程6.4　HJM条件6.5　短期利率的马氏性6.6　Hull—White模型6.7　练习第七章　远期测度和衍生产品定价7.1　远期测度7.2　远期测度下的动态过程7.3　衍生产品的定价7.4　测度逆变换7.5　练习第八章　拟合曲线和双因子模型8.1　曲线拟合8.2　确定性函数变换8.3　相关性问题8.4　双因子模型8.5　练习第九章　LIBOR模型中利率上限和利率互换期权的定价9.1　利率上限的定价9.2　远期利率测度和期权结构9.3　互换和互换期权9.4　伦敦银行间同业拆借利率（LIBOR）.模型9.5　LIBOR市场中的互换率9.6　远期互换测度9.7　LIBOR模型中的互换期权定价9.8　练习第十章　Brace-Gatarek-Musiela（BGM）模型第十一章　附录A：数学工具第十二章　附录B：相关进展第十三章　习题答案参考文献索引

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