第一图书网, tushu007.com

<<衍生证券与差分法>>

图书基本信息

书名：<<衍生证券与差分法>>

13位ISBN编号：9787510044045

10位ISBN编号：7510044049

出版时间：2012-6

出版时间：世界图书出版公司

作者：朱友兰

页数：513

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

<<衍生证券与差分法>>

内容概要

《衍生证券与差分方法》旨在为读者提供运用偏微分方程为金融衍生品定价的方法。
在第一部分书中描述了所涉及问题的公式；第二部分讲述如何有效地获得欧式和美式衍生物以及股票期权和利率衍生物的数值解。
书中所用到的数值方法讨论的都是有限差分方法。
书中也讨论了如何确定这些在偏微分方程中的关系。
本书另一个目的是为有工程计算经验的编程人员提供有效的衍生物定价编码技巧。
全书通篇包括练习，可以吸引大量的计量金融中的学生和科研人员，以及金融工业和编码方面的工作者。

读者对象：数学、金融、经济以及相关专业的科研人员。

第一图书网, tushu007.com

<<衍生证券与差分法>>

书籍目录

第一部分 金融中的偏微分方程：导论
基本期权
奇异期权
利率衍生证券
第二部分 衍生证券的数值方法：基本数值法
初始边界值和lc问题
自由边界问题
利率模型

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