

<<金融衍生产品定价教程>>

图书基本信息

书名：<<金融衍生产品定价教程>>

13位ISBN编号：9787300112886

10位ISBN编号：7300112889

出版时间：2010-1

出版时间：中国人民大学出版社

作者：张树德 编

页数：316

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>

## <<金融衍生产品定价教程>>

### 内容概要

本书的主要内容包括如下几个方面。

#### (1) MATLAB基础。

主要介绍了MATLAB的基本运算，包括符号运算与非线性运算。

考虑到并行计算式金融计算未来的发展趋势，《金融衍生产品定价教程》介绍了MATLAB自带的并行计算函数，同时介绍了美国交互超级计算公司开发的Star-P并行计算系统。

#### (2) 股票期权定价与组合。

主要介绍了欧式期权解析解和二叉树算法，并介绍了如何利用MATLAB对期权组合进行盈亏分析和风险管理。

#### (3) 利率产品定价和敏感性分析。

主要介绍了如何利用MATLAB金融工具箱中的函数计算常见利率衍生产品的价格及其组合的风险管理。

#### (4) 金融数据可视化。

主要介绍了基本的金融数据绘图函数，并介绍了调用底层函数完成复杂金融数据绘图的方法。

为了体现金融数据的表现力，还介绍了多维数据和动态绘图方法。

## <<金融衍生产品定价教程>>

### 书籍目录

第1章 MATLAB基础 1.1 矩阵及向量运算 1.2 符号计算 1.3 非线性方程求解 1.4 并行计算第2章 股票类衍生产品计算 2.1 股票类衍生产品的种类 2.2 欧式期权价格计算 2.3 波动率微笑和波动率期限结构 2.4 股票类衍生产品定价数值解 2.5 股票类衍生产品定价函数 2.6 股票类衍生产品敏感性及定价函数第3章 期权组合策略 3.1 去气压表投资策略介绍 3.2 期权组合 3.3 期权盈亏分析及投资策略第4章 利率类衍生产品定价及敏感性分析 4.1 利率类衍生产品基础 4.2 利率类衍生产品敏感性分析第5章 期权敏感性对冲策略 5.1 非线性求解最优化组合 5.2 期权对冲投资策略第6章 有限差分法定价 6.1 有限差分法基本原理 6.2 有限差分求解方法 6.3 有限差分得稳定性第7章 蒙特卡洛模拟金融衍生产品定价 7.1 随机模拟基本原理 7.2 蒙特卡洛方法没骗你期权定价 7.3 最小二乘蒙特卡洛法模拟美式期权第8章 金融数据的初级可视化技术 8.1 图形对象和句柄 8.2 利用图形图像窗口编辑图形第9章 金融数据的高级可视化技术 9.1 多维金融数据处理 9.2 金融数据动态显示参考文献

<<金融衍生产品定价教程>>

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>