

<<衍生金融工具定价>>

图书基本信息

书名：<<衍生金融工具定价>>

13位ISBN编号：9787509509425

10位ISBN编号：7509509424

出版时间：2008年5月

出版时间：中国财政经济出版社

作者：赵胜民

页数：251

字数：393000

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>

<<衍生金融工具定价>>

内容概要

本教材根据金融工程专业学生的特点，按先易后难、由浅入深的顺序组织内容。

首先讨论离散时间模型，并借此介绍基本的定价原理，然后再讨论复杂的连续时间模型。

同时，书中所用数学知识尽量限制在高等数学、线性代数和概率论范围内。

超出这个范围的微分方程和随机过程等方面知识，都在书中给予扼要的介绍，尽量实现自封闭。

同时对于微分方程和随机过程等复杂数学内容的介绍，尽可能回避抽象的数学概念，采用学生较为熟悉的概念去描述。

对于用到的数学结论，一般都只给出解释，而不给予严格的证明，至多为了加深学生理解，给出证明的大意。

对于一些结论，在可能的情况下，注意利用几何图形进行解释，降低学生学习的难度。

<<衍生金融工具定价>>

书籍目录

第一章 无套利定价原理

- 第一节 市场无套利的等价条件
- 第二节 状态价格与风险中性概率测度
- 第三节 复制定价技术
- 第四节 市场完备性
- 第五节 二叉树模型和三叉树模型

第二章 二叉树期权定价模型

- 第一节 二叉树模型定价原理
- 第二节 二叉树的构造
- 第三节 Black—Scholes定价公式
- 第四节 Black—Scholes公式分析
- 第五节 数值计算问题

第三章 二叉树模型的改进

- 第一节 利率期限结构
- 第二节 时变波动率情形的二叉树模型
- 第三节 标的资产支付红利情况
- 第四节 美式期权
- 第五节 数值计算问题

第四章 Black—Scholes期权定价模型

- 第一节 股票价格的演化模型
- 第二节 Black—Scholes期权定价模型
- 第三节 Black—Scholes期权定价公式分析
- 第四节 Black—Scholes期权定价模型的推广
- 第五节 数值计算问题

第五章 数值方法

- 第一节 蒙特卡罗模拟定价基本原理
- 第二节 高效的蒙特卡洛定价方法
- 第三节 有限差分方法

第六章 新型期权I

- 第一节 两值期权
- 第二节 复合期权
- 第三节 多维Black—Scholes定价公式
- 第四节 双币种期权
- 第五节 一篮子期权
- 第六节 彩虹期权
- 第七节 数值计算方法

第七章 新型期权II

- 第一节 障碍期权
- 第二节 两值障碍期权
- 第三节 亚式期权
- 第四节 回望期权
- 第五节 数值计算方法

第八章 利率衍生证券

- 第一节 连续利率期限结构
- 第二节 利率衍生品定价的原理

<<衍生金融工具定价>>

第三节 远期价格与期货价格

第四节 利率衍生产品定价的Black模型

第五节 数值计算方法

第九章 利率模型

第一节 单因素利率模型

第二节 多因素模型

第三节 Heath—Jarrow—Morton模型

第四节 数值计算方法

<<衍生金融工具定价>>

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>