

图书基本信息

书名：<<金融工程与衍生产品创新研究:一种基于鞅定价的分析方法>>

13位ISBN编号：9787811121360

10位ISBN编号：7811121360

出版时间：2006年07月

出版时间：云南大学

作者：田存志

页数：240

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

《金融工程与衍生产品创新研究：一种基于鞅定价的分析方法》共分为10章，即导论、股价随机变动过程和鞅定价方法、幂函数族期权的创新与定价、重设型期权的创新与定价、多点重设型幂函数族期权的创新与定价、重设型汇率连动股票期权的创新与定价、重设型股票连动汇率期权的创新与定价、非对称信息下共同基金的融资契约、非对称信息下寡头机构投资者的资产定价模型、非对称信息下的股票价格行为。

书籍目录

第1章 导论1.1 问题的提出及研究目的1.2 金融工程理论研究文献回顾1.3 总体研究思路1.4 本书结构、主要工作和主要创新1.5 研究方法第2章 股价随机变动过程和鞅定价方法2.1 股价随机变动过程2.1.1 连续时间随机过程2.1.2 离散时间随机过程2.2 定价方法2.2.1 偏微分方程定价方法2.2.2 二叉树期权定价方法2.2.3 蒙特卡罗模拟定价方法2.2.4 等价鞅测度定价方法2.3 本章小结第3章 幂函数族期权的创新与定价3.1 基本模型3.2 定价公式3.3 避险参数3.4 不同期权的灵敏度分析3.5 本章小结第4章 重设型期权的创新与定价4.1 重设型幂函数族期权4.1.1 基本模型4.1.2 定价公式4.1.3 风险特征的数值模拟分析4.2 重设型幂函数族牛市买权或熊市卖权4.2.1 基本模型4.2.2 定价公式4.2.3 风险特征分析4.3 本章小结第5章 多点重设型幂函数族期权的创新与定价5.1 基本模型5.2 定价公式5.3 风险特征的数值模拟分析5.4 本章小结第6章 重设型汇率连动股票期权的创新与定价6.1 基本模型6.2 定价公式6.3 重设型汇率连动股票卖权6.3.1 模型6.3.2 定价公式6.4 灵敏度和风险特征的数值分析6.4.1 灵敏度分析6.4.2 风险特征分析6.5 本章小结第7章 重设型股票连动汇率期权的创新与定价7.1 基本模型7.2 定价公式7.3 重设型股票连动汇率卖权7.4 灵敏度和风险特征的数值分析7.4.1 灵敏度分析7.4.2 风险特征分析7.5 本章小结第8章 非对称信息下共同基金的融资契约8.1 问题的提出8.2 基本模型8.2.1 支付契约8.2.2 均衡支付8.3 进一步讨论8.3.1 均衡存在的条件8.3.2 条件的经济含义8.3.3 市场结构对均衡的影响8.3.4 风险厌恶对均衡的影响8.4 实证模拟及结论8.5 本章小结第9章 非对称信息下寡头机构投资者的资产定价模型9.1 问题的提出9.2 模型基本结构9.3 分离定价策略均衡9.4 混同定价策略均衡9.5 市场有效性和无效性的进一步讨论9.6 本章小结第10章 非对称信息下的股票价格行为IO.1 问题的提出IO.2 投机博弈模型10.2.1 模型基本结构10.2.2 均衡定义10.3 博弈均衡及其性质10.3.1 均衡静态性质10.3.2 价格动态性质10.4 本章小结结束语参考文献后记

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>