

图书基本信息

书名：<<金融衍生产品定价的数学模型与案例分析（第二版）>>

13位ISBN编号：9787040385717

10位ISBN编号：7040385716

出版时间：2013-11

出版时间：高等教育出版社

作者：姜礼尚,徐承龙,任学敏,李少华

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

本书可以看作是《期权定价的数学模型和方法》(第二版)的应用卷,全书分为理论篇和案例篇。理论篇进一步展示了偏微分方程方法在期权定价理论中的应用,集中阐明随机分析中鞅方法与偏微分方程方法之间的相互联系,以及Black-Scholes模型的后续发展等;案例篇着重研究在已有定价模型和方法的基础上,针对各种金融和保险创新产品的具体实施条款,建立数学模型(即建立偏微分方程定解问题),求出它的闭合解或数值解,并进行定量分析,讨论一些金融参数和创新产品定价之间的依从关系。

在第二版中,作者更新了部分案例,以反映其最新的研究成果。

本书可作为金融数学专业的教学用书和金融、保险、管理等领域的参考用书,它适用于两类读者:第一类读者是应用数学专业的教师和研究人員,特别是广大攻读金融数学各类学位的研究生和本科生;第二类读者是金融、保险、管理等从业人員,特别是正在从事金融和保险创新产品设计的金融(保险)分析师,金融(保险)机构的决策人員以及相关的研究工作者。

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>