

<<数理金融初步>>

图书基本信息

书名：<<数理金融初步>>

13位ISBN编号：9787111138679

10位ISBN编号：7111138678

出版时间：2004-2

出版时间：机械工业

作者：罗斯

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

这本独到的关于期权定价的书数理推导严密，并不要求读者有概率论知识，易于数学基础一般的读者阅读。

本书清晰简洁地阐述了套利。

Black-Scholes期权定价公式以及效用函数。

最优资产组合原理、资本资产定价模型等知识。

本书第2版引入了许多新的特色，新增了关于金融最优化方法、风险价值系统(VaR)和条件风险价值系统、Black-Scholes方程的简化推导方法。

Black-Scholes期权成本函数偏导数的推导、Black-Scholes公式计算方法、三种带红利的欧式看涨期权模型。

一种新的简单可操作的波动率参数估计方法等内容。

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>