<<不完全金融市场风险最小套期保值及其>>

图书基本信息

书名:<<不完全金融市场风险最小套期保值及其应用>>

13位ISBN编号:9787500576679

10位ISBN编号:7500576676

出版时间:2004-12

出版时间:中国财政经济出版社

作者:王春发

页数:239

字数:181000

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

<<不完全金融市场风险最小套期保值及其>>

内容概要

本书主要内容如下。

第一章主要叙述本书所采用的基本模型和金融背景及其有关概念,并给出一些预备知识。

第二章首先考虑一般未定权的风险最小套期保值问题。

其次讨论一般支付过程的风险最小套期保值问题。

第三章首先给出未定权的局部风险最小策略的定义,然后证明一个交易策略是局部风险最小的充分必要条件是其成本过程是与贴现价格的鞅部分正交的鞅。

其次,我们讨论局部风险最小策略的存在性以及如何确定局部风险最小策略。

最后,我们讨论局部风险最小策略关于计价单位变化的不变性。

第四章首先在一般的框架下讨论均值·方差套期保值问题,其次研究×·投影问题。

然后讨论均值 - 方差套期保值问题。

最后我们还给出了一个关于随机利率下均值 - 方差最优策略的确定。

最后我们给出了一个关于随机利率下均值 - 方差套期保值问题的结果。

第五章将风险最小套期保值方法应用于投资连结保险合同。

第六章考虑局部风险最小对冲方法的应用。

第七章研究由于不完全信息而导致随机波动率的利率模型的套期保值问题。

第八章在不完全信息情形下研究到期时间为T0未定权的均值 - 方差最小套期保值问题。

第九章研究不完全市场情形中期货的套期保值问题。

<<不完全金融市场风险最小套期保值及其>>

作者简介

王春发,1957年出生。

1987年毕业于西安电子科技大学应用数学系并获硕士学位。

1999年毕业于复旦大学管理学院,获博士学位。

现为浙江财经学院金融分院金融工程与投资学副教授,金融工程研究所所长。

主要从事金融工程和投资学的教学与研究工作。

著有《现代金融工程原理——一般均衡方法及其应用》。

先后在《数学学报》、《数量经济和技术经济研究》、《系统工程学报》、《系统工程理论方法应用》、《数学的认识与实践》、《应用数学》、《经济数学》等学术期刊发表论文40多篇。

先后在国际计量经济协会第七次东京世界大会和丹麦University of Aarhus金融与保险数学国际会议上作大会和小组发言。

<<不完全金融市场风险最小套期保值及其>>

书籍目录

第一章 基本模型和预备知识 1.1 基本模型和一般背景 1.2 预备知识 第二章 风险最小套期保值 2.1 未定权的风险最小套期保值 2.2 一般支付过程的风险最小套期保值第三章 局部风险最小套期保值 3.1 未定权的局部风险最小套期保值 3.2 一般支付过程的局部风险最小套期保值 3.3 局部风险最小策略关于计价单位变化的不变性第四章均值 - 方差最小套期保值 4.1 一般问题 4.2 × - 投影问题 4.3 均值 - 方差最优解的确定 4.4 随机利率下的均值 - 方差最小套期保值第五章 投资连结保险合同的风险最小套期保值 5.1 金融市场模型 5.2 一次性投资连结保险合同的风险最小套期保值 5.3 多次支付投资连结保险合同的风险最小套期保值 5.4 非生命保险中的指数连结赔付的风险最小套期保值第六章 投资连结保险合同的局部风险最小套期保值 6.4 能机利率下权益连结人寿保险合同的局部风险最小套期保值 6.4 随机利率下权益连结人寿保险合同的局部风险最小套期保值 7.1 一个具有随机波动率的利率期限结构模型 7.2 具有随机波动率利模型的最小鞅测度 7.3 利率衍生工具的局部风险最小套期保值第八章 利率模型的均值 - 方差最小套期保值第九章 期货的均值 - 方差最小套期保值第九章 期货的均值 - 方差最小套期保值第九章 期货的均值 - 方差最小套期保值第九章

<<不完全金融市场风险最小套期保值及其>>

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