

<<金融衍生工具理论与实践>>

图书基本信息

书名：<<金融衍生工具理论与实践>>

13位ISBN编号：9787810888219

10位ISBN编号：7810888218

出版时间：2007-10

出版时间：西南财经

作者：菲尔·亨特

页数：402

译者：朱波

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>

<<金融衍生工具理论与实践>>

内容概要

《金融衍生工具理论与实践（修订版）》分为自成体系的两个部分。第一部分致力于阐述资产定价领域所需的随机微积分理论，第二部分更多地关注金融衍生工具建模的实践方面。对金融学基础较好而数学基础薄弱的读者而言，本书为你弥补资产定价领域所需数学知识提供了一个很好的引导；对那些数学基础较好而又对金融感兴趣的读者而言，本书为你快速进入相关主题提供了一个很好的通道；对金融工程和数理金融专业的学生而言，本书是一本很合适的教材。

<<金融衍生工具理论与实践>>

作者简介

朱波，1977年出生于四川省宣汉县，1995年考入两南师范大学数学系，1999年6月获理学学士学位，2002年6月获理学硕士学位，同年9月考入中国社会科学院数量经济技术经济研究所，2005年6月获经济学博士学位。

现任职于西南财经大学金融学院，从事金融学的教学和科研工作，主授课程：连续时间金融、资产定价、实证金融、金融随机过程、金融工程、衍生金融工具。

研究方向：资产定价、实证金融、金融工程。

<<金融衍生工具理论与实践>>

书籍目录

第一部分 理论1 单期期权定价1.1 期权定价简介1.2 最简单的情形1.3 一般的单期模型1.4 两期例子2 布朗运动2.1 引言2.2 定义和存在性2.3 布朗运动的基本性质2.4 强马尔可夫性3 鞅3.1 定义和基本性质3.2 鞅的类别3.3 停时和选样定理3.4 变差、平方变差与积分3.5 局部鞅和半鞅3.6 上鞅和Doob-Meyer分解4 随机积分4.1 概述4.2 可预测过程4.3 随机积分：L2理论4.4 随机积分的性质4.5 通过局部化进行扩展4.6 随机积分：Ito公式5 Girsanov和鞅表示5.1 等价概率测度和Radon-Nikodym导数5.2 Girsanov定理5.3 鞅表示定理6 随机微分方程6.1 引言6.2 SDE的正式定义6.3 规范框架的剩余部分6.4 弱解和强解6.5 存在性和唯一性的证明：Ito理论6.6 强马尔可夫性6.7 再访鞅表示定理7 连续时间期权定价7.1 资产价格过程和交易策略7.2 欧式期权定价7.3 连续时间理论7.4 扩展8 动态期限结构模型8.1 引言8.2 纯贴现债券经济8.3 对期限结构进行建模

第二部分 实践9 建模实践9.1 引言9.2 真实世界不是鞅测度9.3 以产品为基础的建模9.4 局部校准与全局校准10 基础工具和术语10.1 引言10.2 存单10.3 远期利率协议10.4 利率互换10.5 零息债券10.6 贴现因子与价值评估11 标准市场衍生产品的定价11.1 引言11.2 远期利率协议与互换11.3 上限期权和下限期权11.4 大众型互换期权11.5 数字期权12 期货合约12.1 引言12.2 期货合约的定义12.3 期货价格过程的刻画12.4 价格过程的复原12.5 远期和期货之间的关系13 终端互换利率模型13.1 引言13.2 终端时间建模13.3 终端利率模型的例子13.4 终端互换利率模型的无套利性质13.5 零息互换期权14 凸性校正14.1 引言14.2 “凸性关联”产品的价值评估14.3 例子和扩展15 隐含利率定价模型15.1 引言15.2 Dts隐含的函数形式15.3 数值计算15.4 不规则互换期权15.5 指数和隐含互换利率模型的数值比较16 多种货币终端互换利率模型16.1 引言16.2 模型构建16.3 例子17 短期利率模型17.1 引言17.2 著名的短期利率模型17.3 Vasicek-Hull-White模型的参数拟合17.4 百慕大互换期权与Vasicek-Hull-White模型18 市场模型18.1 引言18.2 LIBOR市场模型18.3 规则互换市场模型18.4 逆向互换市场模型19 马尔可夫函数建模19.1 引言19.2 马尔可夫函数模型19.3 用一维马尔可夫函数模型来拟合互换期权的价格19.4 模型举例19.5 多维马尔可夫函数模型19.6 与市场模型之间的关系19.7 均值反转、远期波动率和相关性19.8 一些数值结果20 习题及解答附录1 通常性条件附录2 L2空间附录3 高斯计算参考文献

<<金融衍生工具理论与实践>>

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>