

<<金融衍生工具中的数学>>

图书基本信息

书名：<<金融衍生工具中的数学>>

13位ISBN编号：9787810889384

10位ISBN编号：7810889389

出版时间：2008-6

出版时间：西南财经大学出版社

作者：Salih N.Nrftci

页数：430

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>

<<金融衍生工具中的数学>>

内容概要

《金融衍生工具中的数学(第二版)》以现代资产定价理论所需的基本数学工具进行了系统全面的介绍, 主要内容包括套利定理、风险中性概率、维纳过程、泊松过程、Ito微积分、鞅、偏微分方程、Girsanov定理、Feynman-Kac公式等。

该书的一个特色, 用简单、清晰的方式将相关数学知识与金融应用很好地结合起来, 既为读者弥补了相应数学知识, 又能让读者明白这些数学知识在资产定价中是如何应用的。

《金融衍生工具中的数学(第二版)》第二版分为两个部分。

第一部分基本上是对第一版进行修订和扩展, 共15章。

第二部分是新增的, 内容更加新颖复杂, 共7章。

总的来说, 与第一版相比, 这一版本的内容几乎增加了一倍。

前15章以对印刷和其它错误进行了修订, 并新增了几节内容。

《金融衍生工具中的数学(第二版)》的新颖之处体现在第二部分的7章内容之中。

这几章使用的方法与第一分类似, 涉及固定收益产品和利率产品中的数学工具。

最后一章是停时和美式衍生工具的简略介绍。

<<金融衍生工具中的数学>>

作者简介

朱波，1977年出生于四川省宣汉县，1995年考入西南师范大学数学系，1999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。

<<金融衍生工具中的数学>>

书籍目录

第1章 金融衍生工具简介第2章 套利定理基础知识第3章 确定环境和随机环境中的微积分第4章 金融衍生工具定价：模型与记号第5章 概率论中的工具第6章 鞅和鞅表示第7章 随机环境中的微分第8章 维纳过程与金融市场中的稀有事件第9章 随机环境中的积分：Ito积分第10章 Ito引理第11章 衍生资产价格的动态演变：随机微分方程第12章 衍生产品定价：偏微分方程第13章 Black—Scholes PDE应用第14章 衍生产品定价：等价鞅测度第15章 等价鞅测度：应用第16章 利率敏感型证券的新结果和工具第17章 新框架下的套利定理：正规化和随机利率第18章 期限结构建模及相关概念第19章 固定收益证券的经典方法和HJM方法第20章 利率衍生产品的经典PDE分析第21章 条件期望与PDE之间的关系第22章 停时与美式证券参考文献

<<金融衍生工具中的数学>>

章节摘录

第1章 金融衍生工具简介 2 定义 用实践者的话来说,“衍生证券就是金融合约,合约的价值可以用现货市场工具如股票、债券、货币和商品等的价格‘推导’出来。

”“金融衍生工具”的学术定义要准确得多。

定义:金融合约是在到期日T的价值由T时刻标的现金流工具的市场价格来精确确定的衍生证券或未定权益(Ingersoll,1987)。

<<金融衍生工具中的数学>>

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>