

《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：2008-3

出版社：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以及在线试读，请支持正版图书。

更多资源请访问：www.tushu111.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，《金融衍生工具理论与实践(修订版)》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，《金融衍生工具理论与实践(修订版)》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，《金融衍生工具理论与实践(修订版)》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。

书籍目录

第 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 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:www.tushu111.com