

《利率互换及其衍生品》

图书基本信息

书名：《利率互换及其衍生品》

13位ISBN编号：9787564215119

出版时间：2013-8-1

作者：阿莫·萨德 (Amir Sadr)

页数：192

译者：梁进,李佳彬

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

《利率互换及其衍生品》

内容概要

《利率互换及其衍生产品(从业者指南)》由阿莫·萨德著，是最新的一本关于阐释利率互换及其衍生产品的书。它填补了这些工具与其日常生活中实际使用之间的空白。作者阿莫·萨德作为经验丰富的宽客、交易员、金融软件开发人员和固定收益领域的学者，详细解释了主要的“利率”产品，包括互换、上下限期权、百慕大期权等。《利率互换及其衍生产品(从业者指南)》也详细解释了奇异/结构性票据的主要估值技巧——仍然是市场面临的最重要的挑战之一。对于正在和即将进行利率产品交易的人员，本书是重要的参考指南。

书籍目录

- 总序
- 序言
- “利率”市场
- 背景
- 本书结构
- 致谢
- 符号和缩略语
- 第一部分 现金、回购和互换市场
- 第一章 债券：纯属贴现问题
- 货币的时间价值：终值、现值
- 价格-收益公式
- PV01、PVBP、凸率
- 回购、逆回购
- 远期价格收益、套息和向前滚动
- 第二章 互换：仍是贴现问题
- 贴现因子曲线、零息曲线
- 远期利率曲线
- 平价—互换曲线
- 互换Libor曲线的构造
- 第三章 现实中的利率互换
- 市场工具
- 互换交易——利率或差价
- 互换差价
- 风险、PV01、伽玛层级
- 日历规则、日期细节
- 第四章 从贴现曲线中分离远期曲线
- 资产的远期曲线
- 隐含远期利率
- 浮动浮动互换
- LiborLibor基础互换
- 隔夜指数互换
- 第二部分 利率流期权
- 第五章 衍生品定价：风险中性定价
- 欧式相机索取权
- 单步二叉树模型
- 从单一时间步骤到两步骤
- 从两时间步骤到.....
- 相对价格
- 风险中性定价：所有的相对价格必须是鞅
- 利率期权的定价具有内在困难
- 从二叉树模型到等价鞅测度
- 第六章 Black的世界
- 略读随机性
- 资产变化的建模
- Black—Scholes—Merton7Black公式趣
- 希腊字母值
- 二值期权

《利率互换及其衍生品》

看涨期权是你的所有需要
日历交易日、事件波动率
第七章 欧式利率衍生产品
市场实践
利率期权交易
个别上限期权个别下限期权：远期利率期权
欧式互换期权
偏度、波动率微笑
CMS产品
债券期权
第三部分 利率奇异期权
第八章 短期利率模型
快速导览
从动态过程到运算
网格树形运算
BDT网格模型
Hull-White模型及Black-Karasinski模型
模拟运算
第九章 百慕大式期权
Bellman方程——逆向归纳法
百慕大互换期权
百慕大可取消互换、可赎回可兑付债券
百慕大式期权的模拟运算
第十章 全期限结构利率模型
关注从短期利率转向整条曲线：Ho-Lee模型
Heath-Jarrow-Morton全期限结构框架
离散时间、离散期限的HJM框架
远期—远期波动率
多因子模型
HJM框架通常会导致非重组树形
第十一章 远期测度视角
计价单位是任意的
远期测度
BGMJamshidian结果
不同利率的不同测度
“传统的”或“新创的”：挑选你的毒药！
第十二章 寻找“特定”模型
向全期限结构模型的过渡
运算时代
模型与市场：流动性和集中性风险
复杂性风险
其他挑战
附录A 泰勒展开式
单变量函数
多变量函数
伊藤引理：扩散的泰勒展开式
附录B 均值回复过程
正态动态过程
对数正态动态过程

《利率互换及其衍生品》

附录C Girsanov定理和计价单位转换
连续时间、即时远期利率的JM框架
BGM结果

《利率互换及其衍生品》

精彩短评

1、太专业了，没看完...

《利率互换及其衍生品》

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