第一图书网, tushu007.com

<<金融衍生产品定价的数学模型与案 >

图书基本信息

书名：<<金融衍生产品定价的数学模型与案例分析>>

13位ISBN编号：9787040239812

10位ISBN编号：7040239817

出版时间：2008-6

出版时间：高等教育出版社

作者：姜礼尚,徐承龙,任学敏,李少华

页数：293

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

前言

《期权定价的数学模型和方法》（高等教育出版社）自2003年出版至今已有4年，它的英译本《Mathematical Modeling and Methods of Option Pric-ing》（World Scientific Publishing）已在2005年出版，国内很多高校数学系已把它作为本科生和研究生教材，在金融数学专业的高年级大学生和研究生中讲授，反映良好．2008年初该书的第二版已由高等教育出版社出版。

在衍生证券定价的领域中，偏微分方程方法已被愈来愈多的学者所接受，它的影响正在逐渐扩大，为了进一步提高这门课程的教学质量，使得教师和学生能把这门课教好，学好，用好，有必要进一步加深关于随机分析方法与偏微分方程方法之间的相互联系的认识，做到相互沟通，互相启发，把偏微分方程方法的应用提高到一个新水平。

同时要强调理论联系实际，应用Black．Scholes-Merton期权定价理论对金融、保险、投资等各个领域中提出的各种实际案例（产品定价、风险分析和管理决策）进行分析研究，以便达到加深理解，服务社会的目的，本书就是按照这个理念编写的。

本书分成两大篇：理论篇与案例篇，前者可以作为《期权定价的数学模型和方法》的发展和延伸，全篇集中阐明随机分析中Brown运动及相关知识与偏微分方程之间的天然联系，以及Black-Scholes期权定价模型的后续研究和发展。

由我们研究所的一些教师和他们指导下的研究生，结合实际案例所撰写的学术论文组成了本书的案例篇。

内容概要

本书可以看作是《期权定价的数学模型和方法》(第二版)的应用卷，全书分为理论篇和案例篇。理论篇进一步展示了偏微分方程方法在期权定价理论中的应用，集中阐明随机分析中鞅方法与偏微分方程方法之间的相互联系，以及Black-Scholes模型的后续发展等：案例篇着重研究在已有定价模型和方法的基础上，针对各种金融和保险创新产品的具体实施条款，建立数学模型(即建立偏微分方程定解问题)，求出它的闭合解或数值解，并进行定量分析，讨论一些金融参数和创新产品定价之间的依从关系。

本书可作为金融数学专业的教学用书和金融、保险、管理等领域的参考用书，它适用于两类读者：第一类读者是应用数学专业的教师和研究人员，以及广大攻读金融数学各类学位的学生；第二类读者是金融、保险、管理等的从业人员，特别是正在从事金融和保险创新产品设计的金融(保险)分析师、金融(保险)机构的决策人员以及相关的研究工作者。

书籍目录

理论篇期权定价的偏微分方程模型和方法引言第一章 历史回顾 §1.1 Black-Scholes-Merton的前期工作 §1.2 Black-Scholes-Merton的突破性进展 §1.3 Black-Scholes-Merton的后续研究第二章 Brown运动与偏微分方程 §2.1 概率分布与概率密度函数 §2.2 倒向Kolmogorov方程与Feynman-Kac公式 §2.3 首次逸出时间 §2.4 计价单位转换第三章 跳-扩散模型下的期权定价 §3.1 跳-扩散模型 §3.2 期权定价模型 §3.3 期权定价公式第四章 随机利率模型下的期权定价 §4.1 随机利率模型 §4.2 零息票定价公式 §4.3 欧式期权定价公式第五章 随机和不确定波动率模型下的期权定价 §5.1 随机波动率模型和定价公式 §5.2 开关式波动率模型和定价公式 §5.3 不确定波动率模型第六章 支付交易费模型下的期权定价 §6.1 离散时间的期权定价公式 §6.2 连续时间的期权定价模型——Leland方程参考文献案例篇 金融衍生产品的定价模型与分析第一章 与黄金价格挂钩的存款理财产品（一） §1.1 问题的提出 §1.2 模型的建立 §1.3 模型的求解 §1.4 另一款看涨保本型产品的数学模型 参考文献第二章 与黄金价格挂钩的存款理财产品（二） §2.1 问题的提出 §2.2 模型的建立 §2.3 模型的求解 §2.4 关于模型的进一步讨论 参考文献第三章 与汇率挂钩的外币存款理财产品 §3.1 问题的提出 §3.2 模型的建立 §3.3 模型的求解 参考文献第四章 触发式汇率期权定价的数学模型 §4.1 问题的提出 §4.2 模型的建立 §4.3 模型的求解 §4.4 对产品性质的讨论 §4.5 对模型的进一步分析 参考文献第五章 结构性人民币存款产品的定价分析 §5.1 问题的提出 §5.2 模型的建立 §5.3 问题的求解及数值计算 附录 参考文献第六章 定期存款所含嵌入期权的定价 §6.1 引言 §6.2 基本假设 §6.3 问题的求解 §6.4 问题解的一些性质 §6.5 结论 参考文献第七章 收益与汇率变化范围挂钩的存款产品的定价 §7.1 问题的提出 §7.2 数学模型和求解 §7.3 以本币付息时的一些定性分析 §7.4 结论 附录 参考文献第八章 可延期交付的附息票债券期权定价 §8.1 问题的提出 §8.2 基本假设与数学模型 §8.3 模型的求解 §8.4 模型的讨论 §8.5 一些说明 参考文献第九章 随机利率模型下欧式看涨外汇期权定价分析 §9.1 问题的提出 §9.2 基本假设与数学模型 §9.3 模型的求解 §9.4 模型的讨论 参考文献第十章 保底型基金的设计与定价 §10.1 引言 §10.2 数学模型 §10.3 定解问题的简化与求解 §10.4 数值分析 参考文献第十一章 券商集合理财产品的分析与定价 §11.1 问题的背景 §11.2 模型的建立 §11.3 定价模型的求解 §11.4 佣金比率、自付率和承诺收益之间关系的讨论 §11.5 数值计算 参考文献第十二章 上市公司融资策略（1）——数量可变的购买期权 §12.1 问题的提出 §12.2 VPO的基本条款和种类 §12.3 固定利率下VPO模型的建立 §12.4 随机利率下欧式VPO定价模型的求解 附录 参考文献第十三章 上市公司融资策略（2）——转股价可向下修正的可转换债券 §13.1 实际背景 §13.2 数学模型 §13.3 模型的求解 附录 参考文献第十四章 带回售及可调转股价条款的可转换债券的定价与计算 §14.1 问题的提出 §14.2 一类带回售及可调转股价条款的可转债的数学模型 §14.3 问题的求解 §14.4 问题的进一步讨论 参考文献第十五章 信用关联结构性存款的定价 §15.1 引言 §15.2 基本假定 §15.3 定解问题的简化及求解 参考文献第十六章 结构化方法下第二类欧式信用衍生物的定价 §16.1 引言 §16.2 数学模型 §16.3 问题的求解 附录 参考文献第十七章 一类具有违约风险的房产期权的定价模型和分析 §17.1 问题的提出 §17.2 模型的建立 §17.3 模型的求解 参考文献第十八章 一类房产期权的二叉树定价模型和分析 §18.1 问题的提出 §18.2 二叉树定价模型 §18.3 二叉树格式的数值模拟和参数分析 §18.4 结论 参考文献第十九章 标准信用违约互换定价 §19.1 问题的提出 §19.2 模型的建立 §19.3 模型的求解 §19.4 数值计算 参考文献第二十章 一篮子信用违约互换定价 §20.1 问题的提出 §20.2 模型的建立 §20.3 模型的求解 §20.4 数值计算 参考文献

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