

<<金融风险 and 衍生证券定价理论>>

图书基本信息

书名：<<金融风险 and 衍生证券定价理论>>

13位ISBN编号：9787040239829

10位ISBN编号：7040239825

出版时间：2008-5

出版时间：高等教育出版社

作者：（法）布沙尔，（加）波特 著

页数：379

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>

## <<金融风险 and 衍生证券定价理论>>

### 内容概要

本书由剑桥大学出版社出版，原书名为：Financial Engineering and Computation: Principles, Mathematics, and Algorithms，是一本非常优秀的有关金融计算的图书。

如今打算在金融领域工作的学生和专家不仅要掌握先进的概念和数学模型，还要学会如何在计算上实现这些模型。

《金融风险 and 衍生证券定价理论》内容广泛，不仅介绍了金融工程背后的理论和数学，并把重点放在了计算上，以便和金融工程在今天资本市场的实际运作保持一致。

《金融风险 and 衍生证券定价理论》不同于大多数的有关投资、金融工程或者衍生证券方面的书，而是从金融的基本想法开始，逐步建立理论。

作者提供了很多定价、风险评估以及项目组合管理的算法和理论。

<<金融风险 and 衍生证券定价理论>>

作者简介

作者：(法国)布沙尔(Bouchaud.J.P.) (加拿大)波特(Potters.M.)

<<金融风险 and 衍生证券定价理论>>

书籍目录

Preface  
1 Probability theory: basic notions  
2 Maximum and addition of random variables  
3 Continuous time limit, Ito calculus and path integrals  
4 Analysis of empirical data  
5 Financial products and financial markets  
6 Statistics of real prices: basic results  
7 Non-linear correlations and volatility fluctuations  
8 Skewness and price-volatility correlations  
9 Cross-correlations  
10 Risk measures  
11 Extreme correlations and variety  
12 Optimal portfolios  
13 Futures and options: fundamental concepts  
14 Options: hedging and residual risk  
15 Options: the role of drift and correlations  
16 Options: the Black and Scholes model  
17 Options: some more specific  
18 Options: minimum variance Monte-Carlo  
19 The yield curve  
20 Simple mechanisms for anomalous price statistics  
Index of most important symbols  
Index

<<金融风险 and 衍生证券定价理论>>

章节摘录

插图：

## <<金融风险 and 衍生证券定价理论>>

### 编辑推荐

《金融风险 and 衍生证券定价理论:从统计物理到风险管理(第2版)(影印版)》的重点是有关金融产品和衍生证券、期权、期货、远期、利率衍生产品、抵押证券等等的定价问题。

每个工具都有简要的介绍，每章都可以独立被引用。

《金融风险 and 衍生证券定价理论》的算法均使用Java算法编程实现的，并可以在相关的网站上下载。

《金融风险 and 衍生证券定价理论》适合经济学、金融数学专业的学生、教师，以及从事金融事务领域的相关人员使用参考。

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>