

<<外汇风险>>

图书基本信息

书名：<<外汇风险>>

13位ISBN编号：9787310021406

10位ISBN编号：7310021401

出版时间：2004-12

出版时间：南开大学出版社

作者：哈卡拉

页数：555

字数：514000

译者：戴金平

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>

<<外汇风险>>

内容概要

本书全面介绍了外汇衍生产品数理研究的历史和最新发展。外汇市场是全球流动性最强的市场之一，交易是全球性的和连续性的。然而，交易的货币品种很少，只有美元、日元、欧元、英镑，还有瑞士法郎、澳大利亚和加拿大元等少数几种货币。

本书介绍了外汇衍生品数量研究的历史和最新发展。我们讨论了一些市场品种及其定价问题、基本数理工具、希腊符号、风险管理和相关性管理。传统的期权定价理论是Black-Scholes-Merton模型，其数学方法简单，被市场广泛接受，并被视为期权定价理论的基石。

本书各章的作者都不同，但我们还是采取了一些方法使全书作为一个整体从而具有可读性。各部分可以独立成章。

我们希望读者喜欢本书。

我们选入了本专题的最新研究成果，并将其有机地结合在一起，成为完整的体系，使各部分简单易懂

。

<<外汇风险>>

作者简介

Annette Andreas在法兰克福Hessen-thuringen土地银行工作。
他在法兰克福的Goethe大学完成其数学专业的毕业论文《展期期权定价方法的比较》，研究方向是随机过程和金融。

Thomas Apel德国Chemnitz理工大学数学学院的助理教授。
他擅长于偏微分方程求解的数理方法，在C

<<外汇风险>>

书籍目录

序致谢作者简介第一部分 市场：产品与基础知识 第1章 香草期权 第2章 波动率管理 第3章 终止日和交割日不同的处理 第4章 非交易日对期权定价的影响 第5章 障碍期权——简介 第6章 第一代变异期权的定价 第7章 第二代变异期权的定价 第8章 双重货币标价期权 第9章 无套利边界和复合期权的静态保值 第10章 从公司角度来看的零成本结构 第11章 概率密度函数和相关工具 第12章 关于以远期为基础的衍生产品的前向后向偏微第二部分 风险管理 第13章 利用同质性和其他技巧简化计算期权价格的敏感性参数 第14章 如何利用敏感性参数来对冲外汇期权的关联风险第三部分 变异期权的模型和应用 第15章 亚式期权和篮子期权定价的算术平均模型及其应用 第16章 有限差分法 第17章 蒙特卡罗模拟和方差缩减技术 第18章 准随机序列及其在篮子期权和回顾期权定中的应用 第19章 拟蒙特卡罗技术对多资产期权的定价 第20章 二叉树法 第21章 快速傅立叶变换法对涉及几种货币的期权的定价 第22章 市场波动率曲线——波动率微笑的应用 第23章 Heston随机波动率模型在外汇期权中的应用 第24章 用有限元法在Heston随机波动率模型框架下为期权定价 第25章 跳跃—扩散模型在外汇市场中的应用 第26章 长期外汇期权的定价模型 第27章 管理数字期权词汇对照表

<<外汇风险>>

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>