

<<金融衍生工具与内部模型>>

图书基本信息

书名：<<金融衍生工具与内部模型>>

13位ISBN编号：9787509612149

10位ISBN编号：7509612144

出版时间：2011-1

出版时间：经济管理出版社

作者：汉斯·皮特·多伊奇

页数：482

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>

<<金融衍生工具与内部模型>>

内容概要

《金融衍生工具与内部模型（第2版）》的目的是详细介绍一些方法和步骤，借此可以标定金融工具和产品，量化和控制风险。

作者汉斯-皮特在介绍完这些基本的风险以及规避风险的金融工具之后，《金融衍生工具与内部模型（第2版）》还定义了建构模型Building Blocks以做更深入的研究。

这将使读者深入正题，即对建构模型的评价和风险的确定。

<<金融衍生工具与内部模型>>

书籍目录

第一部分 基础知识1 导论2 法律环境3 金融市场中的基础风险因素3.1 利率3.1.1 计日规则3.1.2 商业日规则3.1.3 贴现因子3.1.4 复利方法3.1.5 即期利率3.1.6 远期利率3.2 市场价格3.3 金融风险因素的一个直观模型3.3.1 作为定价和风险模型基础的随机游走3.3.2 作为随机游走的风险因素3.4 Ito过程与随机分析3.4.1 一般扩散过程3.4.2 Ito引理3.4.3 转移概率、前向与后向方程3.4.4 Black-Scholes世界中的前向方程与后向方程4 金融工具：一个金融衍生品及其标的资产的体系4.1 现货交易4.1.1 货币市场证券4.1.2 资本市场证券4.1.3 互换4.2 远期交易4.3 期权第二部分 方法5 假设的概况6 现值方法、收益率和传统的风险衡量方法6.1 现值和到期收益率6.2 内部收益率和净现值6.3 应计利息、余值债务和面值利率6.4 利率工具的传统敏感性分析6.4.1 平均寿命和麦考利久期6.4.2 修正久期和凸性6.4.3 传统敏感性分析小结7 套利7.1 远期和约7.1.1 远期价格和贷款借入套利7.1.2 确定远期价格的随机过程7.1.3 远期头寸7.1.4 期货头寸和基差风险7.2 期权7.2.1 期权价格的上限和下限7.2.2 提前执行美式期权7.2.3 看跌期权与看涨期权之间的关系8 布莱克-斯科尔斯微分方程8.1 来源于套利原则的布莱克-斯科尔斯方程8.1.1 欧氏期权的布莱克-斯科尔斯方程8.1.2 对于美式期权而言的布莱克-斯科尔斯方程不等性8.1.3 风险中性世界的第一份合约8.2 布莱克-斯科尔斯方程和后向方程8.2.1 风险中性世界的第二份合约8.3 与热方程之间关系.....第三部分 工具第四部分 风险第五部分 市场数据参考文献

<<金融衍生工具与内部模型>>

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>