

<<双币种期权与时滞期权定价研究>>

图书基本信息

书名：<<双币种期权与时滞期权定价研究>>

13位ISBN编号：9787811139143

10位ISBN编号：7811139146

出版时间：2011-1

出版时间：湖南大学出版社

作者：李亚琼，黄立宏 著

页数：127

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>

<<双币种期权与时滞期权定价研究>>

内容概要

Black-Scholes期权定价公式(1973)是在完备市场假设下得到的, 如何进行符合实际的扩展研究是期权定价的重要工作之一。

本书采用风险中性鞅测度理论、无套利对冲原理、计价单位变化等方法, 以及利用现有的期权定价结论对期权定价的一些扩展问题进行了讨论。

本书中主要讨论了固定汇率制度和浮动汇率制度下的双币种期权定价, 以及股票价格具有时滞响应的期权定价问题。

本书中用于期权定价的方法具有一般性, 因此对其他期权的定价具有参考价值。本书可为金融数学方向的本科生、研究生以及从事相关专业的科研及教学人员参考。

<<双币种期权与时滞期权定价研究>>

书籍目录

第1章 绪论

- 1.1背景和意义
- 1.2文献综述
- 1.3研究方法及结构安排
- 1.4内容的创新

第2章 预备知识

- 2.1布朗过程
- 2.2随机积分与公式
- 2.3欧式期权定价公式及性质

第3章 两种汇率制度下的双币种期权定价

- 3.1多风险资产的期权定价
 - 3.1.1多维布朗过程与公式
 - 3.1.2 多风险资产期权的Black-Scholes公式
- 3.2固定汇率制度的双币种欧式期权定价
 - 3.2.1敲定价格是外币价格
 - 3.2.2敲定价格是国内价格
- 3.3浮动汇率制度下双币种期权定价
 - 3.3.1标的资产用国内价格表示的双币种期权
 - 3.3.2标的资产用国外价格表示的双币种期权
 - 3.3.3双币种期权的价值

第4章 双币种交换期权定价

- 4.1交换期权
- 4.2 固定汇率制度下的双币种交换期权
- 4.3浮动汇率制度下的双币种交换期权

第5章 时滞风险资产的欧式期权定价

- 5.1随机泛函微分方程
- 5.2不支付红利的时滞期权定价
 - 5.2.1扩散项具有时滞的期权定价
 - 5.2.2漂移项和扩散项均具有时滞的期权定价
- 5.3支付红利的时滞期权定价
 - 5.3.1扩散项具有时滞的期权定价
 - 5.3.2 漂移项和扩散项均具有时滞的期权定价

第6章 具有时滞的期权价格动态模型分析

- 6.1具有时滞的期权价格动态模型
- 6.2具有时滞的期权价格动态模型解的存在性
- 6.3具有时滞的期权价格动态模型解的稳定性

第7章 结论

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>