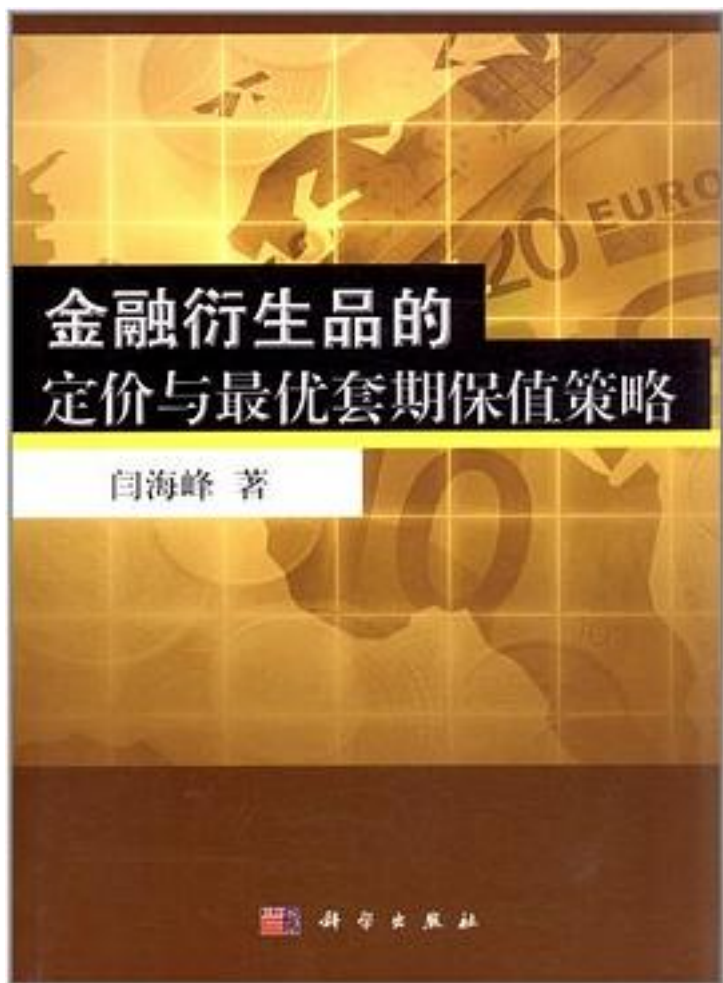


金融衍生品的定价与最优套期保值策略



[金融衍生品的定价与最优套期保值策略_下载链接1](#)

著者:闫海峰

出版者:

出版时间:2012-7

装帧:

isbn:9787030351500

《金融衍生品的定价与最优套期保值策略》系统地研究了指数半鞅模型的未定权益定价和套期保值问题。其中包括：一般指数半鞅模型的资产定价基本定理、未定权益的定价

与套期保值策略；多维扩散过程模型、随机波动率模型、跳扩散半鞅模型的未定权益近似定价，套期保值策略（均值-方差套期保值策略与效用无差别套期保值策略）以及各类等价鞅测度；具有限制信息和附加信息市场模型的套期保值策略。此外，系统介绍了期权定价的鞅方法和保险精算方法。

《金融衍生品的定价与最优套期保值策略》可作为高等院校金融学、金融工程、金融数学、数理统计等相关专业高年级学生和研究生教学参考书，也可供财经类相关专业的研究生、教师、科研工作者和从事金融风险管理以及资产定价方面的实务操作者参考。

作者介绍:

目录:

[金融衍生品的定价与最优套期保值策略_下载链接1](#)

标签

金融衍生品

金融数学

定价

评论

拔头发！我秃了！妈的！难炸了！先马了！这谁顶得住啊！这本书写的也是闻所未闻的东西，买回家看！

[金融衍生品的定价与最优套期保值策略_下载链接1](#)

书评

[金融衍生品的定价与最优套期保值策略_下载链接1](#)