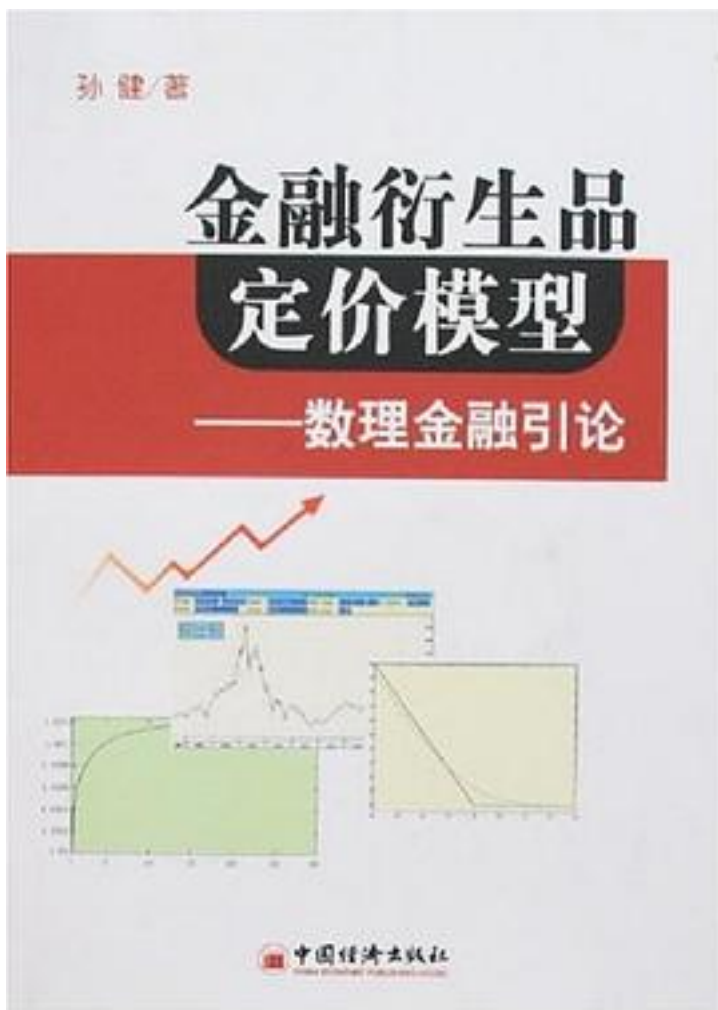


# 金融衍生品定价模型



[金融衍生品定价模型\\_下载链接1](#)

著者:孙健

出版者:中国经济出版社

出版时间:2007-2

装帧:

isbn:9787501778065

本书介绍了主要的股票类金融衍生品的定义和特点，并在此基础上系统讲解了给这些期

权产品定价的数理模型以及实际操作中的对冲方法。

作者介绍:

目录:

[金融衍生品定价模型\\_下载链接1](#)

## 标签

金融衍生品

金融工程

金融

数理金融

模型

Finance

金融学

衍生品

## 评论

这是我本科时和同学翻译的哈哈.现在再读，真的写得不错。非常适合数学系的人念。

-----  
基础理论部分COVER的内容和shreve的随机金融分析一样。全部都是启发式推导。我觉

得要比shreve的要好一些。因为那本跳过的证明太多。看完之后起码知道随机分析那一套玩意儿到底能干嘛了。。我当面问过孙博士本人，做QUANT掌握本书的数学知识是否足够，孙博士给了我一个肯定的答复，做日常的QUANT工作，这本书的数学知识足够了，在这本书的基础上还需要有足够的编程和统计方面的知识就可以入门了。

-----  
孙老师说过，理论方面的书，看他这一本就足够了

-----  
的确是牛人写的书，推荐

-----  
对数学的介绍是比较简略的，但这换来的是对原理的更加透彻和简洁的阐述。

-----  
序言非常抓眼球

-----  
最近在看注会，顺便翻了翻BS模型推导，写的很好，但是我的数学基础不太好，想问问大神看这书需要学数分吗，还是高数概率就能满足了？

-----  
[金融衍生品定价模型\\_下载链接1](#)

## 书评

被本书吸引是看到作者在前言中描述的华尔街面试经验，那些面试问题可以用来检验所有数理金融学的学生水平。这些问题作者还在第13章总结了一下，以此作为基础理论部分的结束，我用这些问题检验了一下自己，做出来应该还可以，但如果要做到在面试中和面试官要对答如流的话...

-----  
[金融衍生品定价模型\\_下载链接1](#)