

<<实物期权定价理论与应用研究>>

图书基本信息

书名：<<实物期权定价理论与应用研究>>

13位ISBN编号：9787111213703

10位ISBN编号：711121370X

出版时间：2007-5

出版时间：机械工业

作者：陈金龙

页数：177

字数：215000

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>

<<实物期权定价理论与应用研究>>

内容概要

本书主要研究实物期权的定价理论和应用。

全书以无套利定价理论继线索，以复制定价、动态规划为基本工具，以Hilbert空间投影理论为指导，在理论上重点研究非完全市场条件下实物期权的定价与风险对冲问题；在应用上重点研究柔性合约的设计与定价、融资灵活性与企业资本结构理论、不良资产最优处置等。

本书适合于从事实物期权理论与应用研究的人员参考，也可作为高等学校硕士研究生、博士研究生的学习参考书，还可作为青年教师科研和教学的参考资料。

<<实物期权定价理论与应用研究>>

书籍目录

第一章 绪论 第一节 研究背景与研究意义 第二节 实物期权定价研究综述 第三节 研究思路及主要研究内容理论部分 第二章 无套利定价基本理论 第一节 无套利与线性定价函数 第二节 无套利与风险中性测度 第三节 测度变换与Girsanov 本章小结 第三章 完全市场条件下的衍生资产定价理论与方法 第一节 完全市场的概念与特征 第二节 完全市场条件下的衍生资产定价方法 第四章 非完全市场条件下的衍生资产定价理论与方法 第一节 概述 第二节 区间定价法 第三节 衍生资产近似定价理论与方法 第四节 市场新出现信息对期权定价的影响 本章小结 第五章 非完全市场效用定价理论 第一节 概述 第二节 单周期资产的0-水平定价法 第三节 连续时间期权的0-水平定价法 本章小结 第六章 资产的价格分布与实物期权定价模型 第一节 市场特征与资产价格变动方式 第二节 资产价格分布模型 第三节 不同资产分布下的实物期权定价模型 本章小结 第七章 基本资产不可交易的实物期权定价与风险对冲 第一节 概述 第二节 基本资产不可交易时无套利定价存在的问题 第三节 实物期权的相关定价方法 第八章 实物期权的比较定价法 第一节 概述 第二节 比较定价法的基本原理 第三节 比较定价法的一个应用 本章小结应用部分 第九章 融资灵活性与公司资本结构 第一节 企业资本结构理论的扩展 第二节 融资灵活性及其定价 第三节 我国股权融资偏好的经济解释 本章小结 第十章 不确定环境下不良资产处置决策 第一节 我国不良资产处置概况 第二节 商业银行不良资产处置模式 第三节 商业银行不良资产处置决策总结与展望参考文献

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>