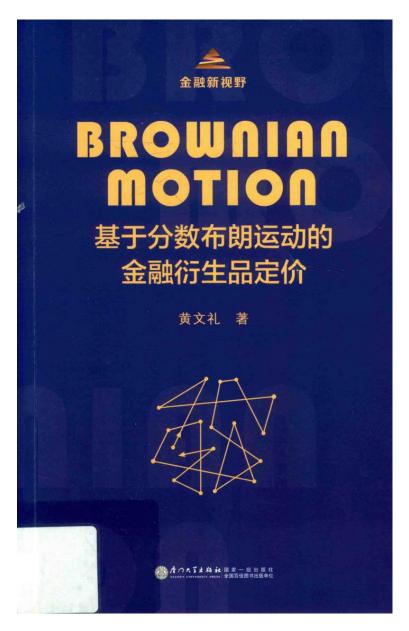
基于分数布朗运动的金融衍生品定价



作者: 黄文礼著

出版社:厦门:厦门大学出版社

出版日期: 2019.01

总页数: 158

介绍:本书假定标的资产服从分数几何布朗运动,从三个方面讨论了Ito型分数金融市场下的期权定价问题,分别是非完备市场中的期权定价问题;随机利率下的期权定价问题;跳一扩散模型下的期权定价问题,推导出了期权定价的一系列结论,并且将讨论的结果应用于两个结构性金融产品当中,还考虑了结构化模型下的信用风险建模。

说明: 登录教客网 (https://www.jiaokey.com/book/detail/14595347.html) 查找全本阅读方式

基于分数布朗运动的金融衍生品定价 评论地址: https://www.jiaokey.com/book/detail/14595347.html

教客网提供千万本图书阅读地址。

https://www.jiaokey.com/book/detail/14595347.html

书名: 基于分数布朗运动的金融衍生品定价