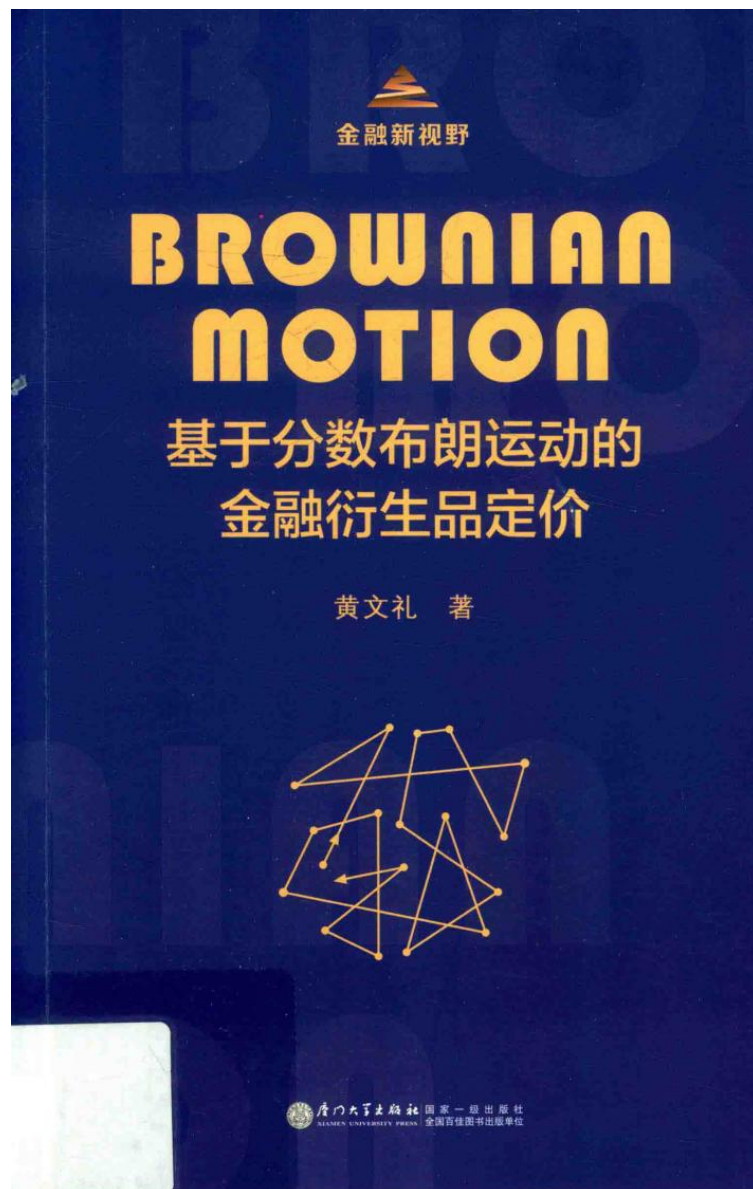


基于分数布朗运动的金融衍生品定价



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-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.jiaoke.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