

《Excel与期权定价》

书籍信息

版次：1

页数：

字数：

印刷时间：2011年08月01日

开本：16开

纸张：胶版纸

包装：平装

是否套装：否

国际标准书号ISBN：9787561539965

内容简介

本书是南开大学金融学系本科生与硕士生课程“金融工程学”配套的实验教材，也是南开金融十几本实验课程教材体系中的一本，全书分为期权的敏感性参数；期权的二叉树定价法；二重期权组合的利损分析等内容。

目录

第一章 期权的B—S定价法

第一节 期权的S定价法模拟

一、期权定价的B—S公式

二、期权B—S公式的图形模拟

三、卖权的图形模拟

第二节 期权的利损曲线

第三节 期权的利损值与无风险利率的关系

第四节 期权的利损值与标的股票价格波动率的关系

第二章 期权的敏感性参数

第一节 Alpha与Delta

一、Alpha()

二、Delta()

第二节 Gamma与Vega

一、Gamma()

[显示全部信息](#)

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www.tushupdf.com](http://www.tushupdf.com)