

# 《外汇风险：模型、工具和管理策略——金融风险 管理译丛》

## 书籍信息

版次：1  
页数：555  
字数：514000  
印刷时间：2004年12月01日  
开本：  
纸张：胶版纸  
包装：平装  
是否套装：否  
国际标准书号ISBN：9787310021406  
丛书名：金融风险管理译丛

## 内容简介

本书全面介绍了外汇衍生产品数理研究的历史和\*发展。外汇市场是全球流动性最强的市场之一，交易是全球性的和连续性的。然而，交易的货币品种很少，只有美元、日元、欧元、英镑，还有瑞士法郎、澳大利亚和加拿大元等少数几种货币。

本书介绍了外汇衍生品数量研究的历史和\*发展。我们讨论了一些市场品种及其定价问题、基本数理工具、希腊符号、风险管理和相关性管理。传统的期权定价理论是Black-Scholes-Merton模型，其数学方法简单，被市场广泛接受，并被视为期权定价理论的基石。

本书各章的作者都不同，但我们还是采取了一些方法使全书作为一个整体从而具有可读性。各部分可以独立成章。我们希望读者喜欢本书。我们选入了本专题的\*研究成果，并将其有机地结合在一起，成为完整的体系，使各部分简单易懂。

## 作者简介

Annette Andreas在法兰克福Hessen-thuringen土地银行工作。他在法兰克福的Goethe大学完成其数学专业的毕业论文《展期期权定价方法的比较》，研究方向是\*过程和金融。

Thomas Apel德国Chemnitz理工大学数学学院的助理教授。他擅长于偏微分方程求解的数理方法，在C

## 目录

### 序

### 致谢

### 作者简介

### 第一部分 市场：产品与基础知识

#### 第1章 香草期权

#### 第2章 波动率管理

#### 第3章 终止日和交割日不同的处理

#### 第4章 非交易日对期权定价的影响

#### 第5章 障碍期权——简介

#### 第6章 第一代变异期权的定价

#### 第7章 第二代变异期权的定价

#### 第8章 双重货币标价期权

#### 第9章 无套利边界和复合期权的静态保值

#### 第10章 从公司角度看的零成本结构

#### 第11章 概率密度函数和相关工具

#### 第12章 关于以远期为基础的衍生产品的前向后向偏微

## 第二部分 风险管理

第13章 利用同质性和其他技巧简化计算期权价格的敏感性参数

第14章 如何利用敏感性参数来对冲外汇期权的关联风险

## 第三部分 变异期权的模型和应用

第15章 亚式期权和篮子期权定价的算术平均模型及其应用

第16章 有限差分法

第17章 蒙特卡罗模拟和方差缩减技术

第18章 准随机序列及其在篮子期权和回顾期权定中的应用

第19章 拟蒙特技术对多资产期权的定价

第20章 二叉树法

第21章 快速傅立叶变换法对涉及几种货币的期权的定价

第22章 市场波动率曲线——波动率微笑的应用

第23章 Heston随机波动率模型在外汇期权中的应用

第24章 用有限元法在Heston随机波动率模型框架下为期权定价

第25章 跳跃—扩散模型在外汇市场中的应用

第26章 长期外汇期权的定价模型

第27章 管理数字期权

词汇对照表

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)