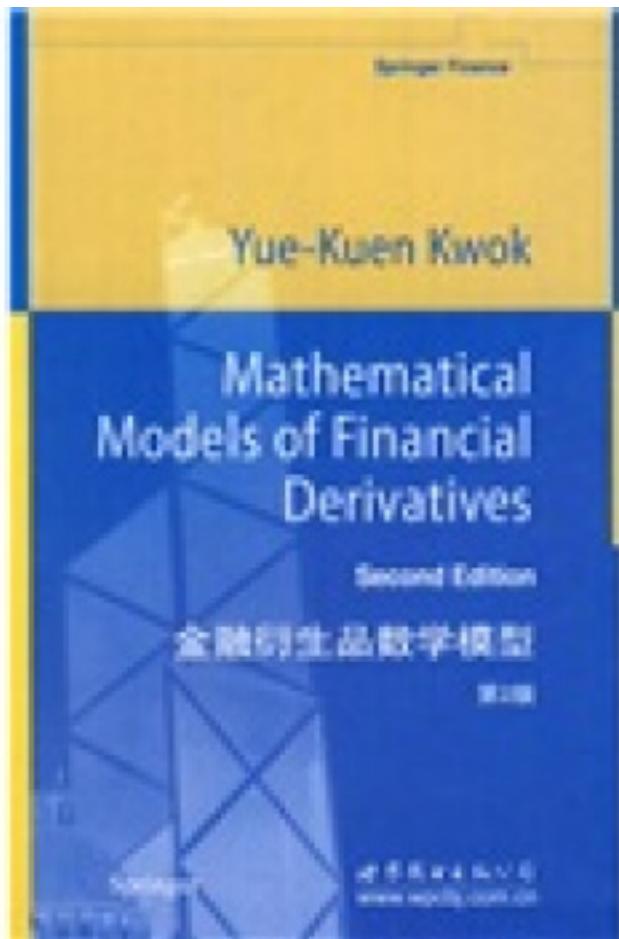


金融衍生品数学模型（第2版）[Mathematical Models of Financial Derivatives Second Edition]



[金融衍生品数学模型（第2版）\[Mathematical Models of Financial Derivatives Second Edition\] 下载链接1](#)

著者:郭宇权 著

[金融衍生品数学模型（第2版）\[Mathematical Models of Financial Derivatives Second Edition\] 下载链接1](#)

标签

评论

还是有些难度，需要有人带一下

非常好 赶上活动价

金融衍生品数学模型（第2版）金融衍生品数学模型（第2版）金融衍生品数学模型（第2版）金融衍生品数学模型（第2版）金融衍生品数学模型（第2版）金融衍生品数学模型（第2版）金融衍生品数学模型（第2版）金融衍生品数学模型（第2版）金融衍生品数学模型（第2版）

书很棒、赞赞赞赞赞

挺不错的书 很具有操作性

quant必备书籍 financial engineer必看 老师推荐了很多次了 讲的很透彻 深入浅出 和一般教材有本质区别 这次满减买的 买了N多quant书存起来慢慢看 京东书品相不错 都是正版 很满意

非常好的书，买回来学习用。微观经济（Microeconomics）（“微观”是希腊文“ $\mu\kappa\rhoο$ ”的意译，原意是“小”)又称个体经济学，小经济学，是现代经济学的一个分支，主要以单个经济单位（单个生产者、单个消费者、单个市场经济活动）作为研究对象分析的一门学科。

微观经济学是研究社会中单个经济单位的经济行为，以及相应的经济变量的单项数值如何决定的经济学说。亦称市场经济学或价格理论。微观经济学（Microeconomics）又称个体经济学，小经济学，是现代经济学的一个分支，主要以单个经济单位（单个生产者、单个消费者、单个市场经济活动）作为研究对象，分析单个生产者如何将有限资源分配在各种商品的生产上以取得最大利润；单个消费者如何将有限收入分配在各种商品消费上以获得最大满足；单个生产者的产量、成本、使用的生产要素数量和利润如何确定；生产要素供应者的收入如何决定；单个商品的效用、供给量、需求量和价格如何确定等等。微观经济学是研究社会中单个经济单位的经济行为，以及相应的经济变量的单项数值如何决定的经济学说；分析个体经济单位的经济行为，在此基础上，研究现代西方经济社会的市场机制运行及其在经济资源配置中的作用，并提出微观经济政策以纠正市场失灵；关心社会中的个人和各组织之间的交换过程，它研究的基本问题是资源配置的决定，其基本理论就是通过供求来决定相对价格的理论。所以微观经济学的主要范围包括消费者选择，厂商供给和收入分配。亦称市场经济学或价格理论。微观经济学的中心理论是价格理论。中心思想是，自由交换往往使资源得到最充分的利用，在这种情况下，资源配置被认为是帕累托有效的。微观经济学包括的内容相当广泛，其中主要有：

均衡价格理论、消费者行为理论、生产者行为理论（包括生产理论、成本理论和市场均衡理论）、分配理论、一般均衡理论与福利经济学、市场失灵与微观经济政策。微观经济学的研究方向微观经济学研究市场中个体的经济行为，亦即单个家庭、单个厂商和单个市场的经济行为以及相应的经济变量。它从资源稀缺这个基本概念出发，认为所有个体的行为准则在此设法利用有限资源取得最大收获，并由此来考察个体取得最大收获的条件。在商品与劳务市场上，作为消费者的家庭根据各种商品的不同价格进行选择，设法用有限的收入从所购买的各种商品量中获得最大的效用或满足。家庭选择商品的行动必然会影响商品的价格，市场价格的变动又是厂商确定生产何种商品的信号。厂商是各种商品及劳务的供给者，厂商的目的则在于如何用最小的生产成本，生产出最大的产品量，获得取最大限度的利润。厂商的抉择又将影响到生产要素市场上的各项价格，从而影响到家庭的收入。家庭和厂商的抉择均通过市场上的

供求关系表现出来，通过价格变动进行协调。因此，微观经济学的任务就是研究市场机制及其作用，均衡价格的决定，考察市场机制如何

通过调节个体行为取得资源最优配置的条件与途径。微观经济学也就是关于市场机制的经济学，它以价格为分析的中心，因此也称作价格理论。微观经济学还考察了市场机制失灵时，政府如何采取干预行为与措施的理论基础。微观经济学是马歇尔的均衡价格理论基础上，吸收美国经济学家张伯伦和英国经济学家罗宾逊的垄断竞争理论以及其他理论后逐步建立起来的。凯恩斯主义的宏观经济学盛

行之后，这种着重研究个体经济行为的传统理论，就被称为微观经济学。微观经济学与宏观经济学只是研究对象有所分工，两者的立场、观点和方法并无根本分歧。两者均使用均衡分析与边际分析，在理论体系上，它们相互补充和相互

依存，共同构成现代西方经济学的理论体系。微观经济学的基本假设：市场出清，即资源流动没有任何障碍；完全理性，即消费者与厂商都是以利己为目的的经济人，他们自觉的按利益最大化的原则行事，既能把最大化作为目标，又知道如何实现最大化；完全信息，是指消费者和厂商可以免费而迅速的获得各种市场信息。

这是一本金融衍生产品定价的经典教材，我很喜欢，买一本来收藏。当然，需要一定的数学功底，比如概率论、随机过程，多少你需要懂一点，不然真的就困难了。

太给力了 梦寐以求的一本书 终于得偿所愿

非常好!买就买经典!只是有的没购物清单，有麻烦!

的学生呀呀呀呀呀呀呀呀呀呀呀呀呀呀呀

很好，书也不错，京东值得信赖

想入门量化的可以考虑，里面都是很棒的模型。

质量很好，非常满意！

不错不错不错不错不错不错不错不错不错不错

很好很快，书很新，不错

好书,还没看,但是应该不错

正品没问题很好

不错，挺给力的，下回还来买

与描述相符，挺好的。

介绍了很多经典的金融数学模型，很有参考价值！

不错，活动时买的，很给力。

作者大牛啊，而且内容比较新

不错不错，还行，还行

非常值得读的好书！虽然有翻译版的，但是还是原版的好！

和中文版一起买来对照看。原版比翻译版贵太多，科学出版社真是抢钱啊～

郭老师的书。

好书一本，强烈金融数学专业的朋友看

全英文版的，有一定难度。

好。 。 。 。 。 。 。

很好的啊，强烈的推荐啦

一直没有时间研究 不过以后应该有用得到的时候

包价格和质量都非常好！建议都买这样的哈哈！

很好的一本书

郭老师的书，买来做教材使用

书选得不错，只是印刷质量不行，有中文译本，翻译得也还不错，价格要贵几十块钱

很好

好评.....

不错

金融衍生产品 (derivatives)是指其价值依赖于基础资产(underlyings)价值变动的合约 (contracts)。这种合约可以是标准化的，也可以是非标准化的。标准化合约是指其标的物(基础资产) 的交易价格、交易时间、资产特征、交易方式等都是事先标准化的，因此此类合约大多在交易所上市交易，如期货。非标准化合约是指以上各项由交易的双方自行约定，因此具[1]有很强的灵活性，比如远期协议。

金融衍生产品是与金融相关的派生物，通常是指从原生资产（英文为Underlying Assets）派生出来的金融工具。其共同特征是保证金交易，即只要支付一定比例的保证金就可进行全额交易，不需实际上的本金转移，合约的了结一般也采用现金差价结算的方式进行，只有在满期日以实物交割方式履约的合约才需要买方交足货款。因此，金融衍生产品交易具有杠杆效应。保证金越低，杠杆效应越大，风险也就越大。

至于金融衍生产品的种类，在国际上是非常多的，而且由于金融创新活动的不断推出新品种，属于这个范畴的东西也越来越多。从基本分类来看，则主要有以下三种分类：

(1) 根据产品形态，可以分为远期、期货、期权和互换四大类。
(2) 根据原生资产分类，即股票、利率、汇率和商品。如果再加以细分，股票类中又包括具体的股票（股票期货、股票期权合约）和由股票组合形成的股票指数期货和期权合约等；利率类中又可分为以短期存款利率为代表的短期利率（如利率期货、利率远期、利率期权、利率互换合约）和以长期债券利率为代表的长期利率（如债券期货、债券期权合约）；商品类中包括各种不同币种之间的比值；商品类中包括各类大宗实物商品。

° (3) 根据交易方法，可分为场内交易和场外交易。场内交易即是通常所指的交易所交易，指所有的供求方集中在交易所进行竞价交易的交易方式。场外交易即是柜台交易，指交易双方直接成为交易对手的交易方式，其参与者仅限于信用度高的客户。

金融衍生产品具有以下几个特点： 1、零和博弈

即合约交易的双方（在标准化合约中由于可以交易是不确定的）盈亏完全负相关，并且净损益为零，因此称“零和”。 2、跨期性

金融衍生工具是交易双方通过对利率、汇率、股价等因素变动的趋势的预测，约定在未

来某一时间按一定的条件进行交易或选择是否交易的合约。无论是哪一种金融衍生工具，都会影响交易者在未来一段时间内或未来某时间上的现金流，跨期交易的特点十分突出。这就要求交易的双方对利率、汇率、股价等价格因素的未来变动趋势作出判断，而判断的准确与否直接决定了交易者的交易盈亏。

金融衍生产品 3、联动性

这里指金融衍生工具的价值与基础产品或基础变量紧密联系，规则变动。通常，金融衍生工具与基础变量相联系的支付特征有衍生工具合约所规定，其联动关系既可以是简单的线性关系，也可以表达为非线性函数或者分段函数。

4、不确定性或高风险性

金融衍生工具的交易后果取决于交易者对基础工具未来价格的预测和判断的准确程度。基础工具价格的变幻莫测决定了金融衍生工具交易盈亏的不稳定行，这是金融衍生工具具有高风险的重要诱因。

当大家看到我的这一篇评价时，表示我对产品是认可的，尽管我此刻的评论是复制黏贴的。这一方面是为了肯定商家的服务，另一方面是为了节省自己的时间，因为差评我会直接说为什么的。所以大家就当作是产品质量合格的意思来看就行了。最后祝京东越来越好，大家幸福平安，中华民族繁荣昌盛。

[金融衍生品数学模型（第2版）\[Mathematical Models of Financial Derivatives Second Edition\]](#) [下载链接1](#)

书评

[金融衍生品数学模型（第2版）\[Mathematical Models of Financial Derivatives Second Edition\]](#) [下载链接1](#)