Record Nr.	UNINA9910826274803321
Titolo	Fourier transform methods in finance / / Umberto Cherubini [et al.]
Pubbl/distr/stampa	Chichester ; ; [Hoboken, NJ], : John Wiley & Sons, c2010
ISBN	0-470-68492-5 1-119-20782-7 1-282-48313-7 9786612483134 0-470-68822-X
Edizione	[1st ed.]
Descrizione fisica	1 online resource (258 p.)
Collana	The Wiley Finance Series ; ; v.524
Altri autori (Persone)	CherubiniUmberto
Disciplina	332.01515723
Soggetti	Options (Finance) - Mathematical models Securities - Prices - Mathematical models Finance - Mathematical models Fourier analysis
Lingua di pubblicazione	Inglese
Lingua di pubblicazione Formato	Inglese Materiale a stampa
Lingua di pubblicazione Formato Livello bibliografico	Inglese Materiale a stampa Monografia
Lingua di pubblicazione Formato Livello bibliografico Note generali	Inglese Materiale a stampa Monografia Description based upon print version of record.
Lingua di pubblicazione Formato Livello bibliografico Note generali Nota di bibliografia	Inglese Materiale a stampa Monografia Description based upon print version of record. Includes bibliographical references and index.
Lingua di pubblicazione Formato Livello bibliografico Note generali Nota di bibliografia Nota di contenuto	Inglese Materiale a stampa Monografia Description based upon print version of record. Includes bibliographical references and index. Fourier Transform Methods in Finance; Contents; Preface; List of Symbols; 1 Fourier Pricing Methods; 2 The Dynamics of Asset Prices; 3 Non-stationary Market Dynamics; 4 Arbitrage-Free Pricing; 5 Generalized Functions; 6 The Fourier Transform; 7 Fourier Transforms at Work; Appendices; A Elements of Probability; B Elements of Complex Analysis; C Complex Integration; D Vector Spaces and Function Spaces; E The Fast Fourier Transform; F The Fractional Fast Fourier Transform; G Affine Models: The Path Integral Approach; Bibliography; Index

1.