

<<金融工程学>>

图书基本信息

书名：<<金融工程学>>

13位ISBN编号：9787040183764

10位ISBN编号：7040183765

出版时间：2006-1

出版时间：高等教育出版社

作者：王光伟

页数：226

版权说明：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：<http://www.tushu007.com>

## &lt;&lt;金融工程学&gt;&gt;

## 内容概要

《高等学校金融学专业课程系列教材：金融工程学（附网络教学课件）》在导论中对金融工程、风险、投机、套利、最优投资组合的确定等重要的核心范畴和内容进行了必要的讨论后，后续各章对重要的基本金融产品和金融衍生工具逐一进行了理论和应用研究，删除了与货币银行学相重复的“资产负债管理技术”的内容、与国际金融学和投资学相重复的“金融市场分析”的内容、与管理学相重复的“产品开发分析”的内容，以及事实上分散蕴含于对每个金融工具讨论中的“积木分析法”等等内容，使得《高等学校金融学专业课程系列教材：金融工程学（附网络教学课件）》内容精炼、紧凑，适合于我国绝大多数高校为该课程设置的一学期（2~3学时/周）的教学工作量。

## 书籍目录

导论——风险与金融工程 §1 金融工程的概念 一、金融工程 二、金融工具 三、盈利：套期保值、套利与投机 §2 风险及其衡量 一、风险 二、系统风险与非系统风险 §3 风险投资组合的选择——可行集与有效集 一、人们对风险的态度分类 二、两种风险资产组合时的可行集与有效集 三、多种风险资产组合的可行集和有效集 四、最优投资组合选择 §4 无风险资产与风险资产的组合 一、一个无风险资产与一个风险资产组合的资本市场线 二、一个无风险资产与多个风险资产组合的资本市场线 三、证券市场线复习思考题金融交易手段创新 §1 交易委托 一、交易委托的数量和时间特征 二、交易委托的种类 §2 保证金账户及其保障机制 一、保证金账户 二、买空交易 三、卖空的含义 四、卖空运作机制 五、综合交易时的保证金要求复习思考题固定收益证券及其违约与定价分析 §1 固定收益证券的含义与种类。

一、固定收益债券的含义 二、政府债券 三、公司债券 四、其他固定收益证券 §2 与债券契约有关的重要条款 一、企业债券契约 二、税收待遇 三、赎回条款 四、偿债基金 五、破产 §3 固定收益证券的价格与收益 一、固定收益证券的价格与内在价值 二、证券的固定收益与浮动利率 三、债券的久期 四、固定收益证券的保值组合 五、违约溢价、风险溢价、收益溢价 六、违约可能性测算 §4 高利风险债券与公司兼并 一、高利风险债券的可转股属性 二、高利风险债券的弹性转换价格 三、高利风险债券的期限设定创新 四、超远期可转换债券复习思考题附录债券的信用评级非固定收益证券——股票及其定价 §1 股票的表决权与认股权 “ 一、表决权 二、认股权 §2 股票的收入资本化定价方法 一、内在价值与净现值 二、股息贴现模型 §3 基于价格—收益比率的定价模型复习思考题资产证券化分析 §1 资产证券化的含义及其发展过程 一、资产证券化的含义 二、资产证券化的发展过程 三、资产证券化的类型 §2 资产证券化的组织结构与运作流程 一、资产证券化的组织结构 二、资产证券化的运作流程 §3 证券定价与现金流 一、没有提前支付情况下的按揭证券现金流分析 二、有提前支付情况下的现金流模型和有关市场惯例 §4 资产证券化的风险 一、资产证券化风险的分类 二、资产证券化后风险和收益的改变复习思考题附录不良资产证券化问题远期合约及其在外汇和货币市场的应用 §1 远期交易简介 一、远期合约的含义 二、远期合约的基本特性 §2 远期外汇交易 一、远期外汇交易的含义与分类 二、远期汇率与利率 三、远期汇率的表现形态 §3 直接远期外汇交易、汇率协议和远期外汇协议 一、直接远期外汇交易 二、汇率协议 三、远期外汇协议 §4 远期利率协议 一、远期利率协议概述 二、远期利率协议的结算 三、远期利率协议中合同利率的确定 四、合同远期利率，对长期利率 $r_L$ 和短期利率 $r_S$ 的敏感性 复习思考题互换及其风险管理

与成本节约效应 §1 互换的基本概念 一、互换的概念 二、互换的作用 §2 互换及互换市场的形成与发展 一、互换的产生 二、互换市场的发展 §3 基本的互换交易 一、商品互换 二、利率互换 三、货币互换 四、更复杂的变形互换 §4 互换的定价 一、利率互换的定价 二、货币互换的定价 三、互换的功能、作用之总结复习思考题期货及其套期保值分析 §1 期货的含义与功能 一、含义与分类 二、期货的功能 三、期货发展的特点 §2 期货交易与期货市场 一、期货交易中的参与者 二、期货交易流程 §3 套期保值与基差分析 一、卖出套期保值与买入套期保值 二、基差及其市场形态 三、基差风险 §4 套期保值比率分析 一、方差法 二、最小二乘法 三、套期保值的效用函数 §5 国债期货套期保值实例 §6 套利交易 一、期货价格的期限结构 二、跨期套利(跨月套利) 三、其他套利形式复习思考题期权理论与期权组合应用 §1 期权的种类 一、期权的含义 二、期权的种类 §2 期权交易 一、期权买卖角色的“了结” 二、股票期权的保护条款 §3 期权交易保证金 §4 期权价值 一、期权到期时(或执行时)的价值 二、期权到期时的损益分析 三、期权(买权)的价值边界 §5 标的物价格变动中的期权价值 一、标的物价格变动与期权的套期保值比率 二、合理的期权价值与无风险套利 §6 布莱克—斯科尔斯模型——买权价值的决定 一、布莱克—斯科尔斯模型 二、利用历史资料估计股票风险 三、利用期权定价模型估计股票风险 四、套期保值比率 五、股票出现分红时对模型的调整 六、卖权定价分析 §7 卖权—买权平价 一、平价关系的建立 二、卖权定价公式的静态分析 三、平价关系与无风险套利 §8 差价期权组合分析 一、垂直差价期权分析 二、水平差价期权分析 §9 期权套期保值实例复习思考题 附录布莱克—斯科尔斯期权定价模型 多期期权及其组合应用 §1 多期期权 §2 利率上限 一、利率上限的含义 二、利率上限合约的结算 三、利差与买卖双方的损益

四、分摊期权费 五、事后的会计核算 六、利率上限互换 § 3利率下限 一、利率下限的含义 二、利率下限互换 § 4利率上下限 § 5参与上限 § 6看涨上限期权 § 7互换期权复习思考题参考书目

## <<金融工程学>>

### 编辑推荐

本书是高等学校金融学专业课程系列教材。

本书在导论中对金融工程、风险、投机、套利、最优投资组合的确定等重要的核心范畴和内容进行了必要的讨论后，后续各章对重要的基本金融产品和金融衍生工具逐一进行了理论和应用研究，删除了与货币银行学相重复的“资产负债管理技术”的内容、与国际金融学和投资学相重复的“金融市场分析”的内容、与管理学相重复的“产品开发分析”的内容，以及事实上分散蕴含于对每个金融工具讨论中的“积木分析法”等等内容，使得本书内容精炼、紧凑，适合于我国绝大多数高校为该课程设置的一学期(2~3学时/周)的教学工作量。

版权说明

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:<http://www.tushu007.com>