

<<风险管理与衍生产品>>

图书基本信息

书名：<<风险管理与衍生产品>>

13位ISBN编号：9787111145738

10位ISBN编号：7111145739

出版时间：2004-8-1

出版时间：机械工业出版社

作者：勒内 M.斯塔茨,殷剑锋,杨涛,程炼

页数：414

译者：殷剑锋,杨涛,程炼

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>

<<风险管理与衍生产品>>

内容概要

本书的目的是将学生培养成衍生产品的使用者，而不仅仅是交易者。通过了解何时及如何运用衍生产品管理风险，管理者和公司都能从中获益。本书以现代公司金融理论为基础，考察了风险价值与风险现金流的测度。然后说明如何度量风险及为已知的风险暴露(利率及汇率风险)套期保值。继而用大量篇幅讨论了期权定价、二项模型、债券及利率期权。之后转向为用户定制的衍生产品，包括掉期、奇异期权及信用风险。全书结构严谨，语言洗练，详略得宜，是一本极好的教科书。

<<风险管理与衍生产品>>

作者简介

勒内M.斯塔茨是俄亥俄州立大学银行与货币经济学讲座教授和Dice金融经济学研究中心主任。他曾经在罗切斯特大学任教，并担任过麻省理工学院和芝加哥大学的访问教职。斯塔茨教授是哈佛商学院1996-1997学年的Marvin Bower访问研究员。他从麻省理工学院获得博士学位。他持有瑞

<<风险管理与衍生产品>>

书籍目录

译者序前言作者简介第一部分 为什么需要风险管理 第1章 导言 第2章 投资者与风险管理 第3章 通过风险管理创造价值 第4章 公司整体水平上的风险管理第二部分 运用远期、期货与期权合同套期保值 第5章 远期与期货合同 第6章 运用远期与期货合同规避风险 第7章 现实世界中的最优套期保值 第8章 识别和管理现金流风险暴露 第9章 度量和利率风险 第10章 用期权进行套期保值 第11章 期权定价、动态套期保值与二项模型 第12章 Black-Scholes模型 第13章 非线性支持的风险度量与风险管理 第14章 债券与利率期权第三部分 超越标准风险管理 第15章 衍生产品的供给和需求 第16章 掉期 第17章 奇异期权的应用 第18章 信用风险与信用衍生产品 第19章 风险管理实践的最新发展第四部分 总结结语参考书目

<<风险管理与衍生产品>>

编辑推荐

金融衍生产品是企业风险管理的重要工具。
本书从风险的度量及其对公司价值的影响入手，详尽地介绍了应该如何运用各种衍生产品作为工具进行风险管理。

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>