

<<金融工程原理>>

图书基本信息

书名：<<金融工程原理>>

13位ISBN编号：9787111302902

10位ISBN编号：7111302907

出版时间：2010-4

出版时间：机械工业出版社

作者：萨利赫 N.内夫茨

页数：666

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>

## 前言

这是一本导论。

它涉及广泛的课题，这些课题以一种逻辑方法贯穿始终，我们通常称这种逻辑方法为金融工程。

本书适用于低年级研究生和金融市场中的从业人士。

书中结合使用了简单的图形、基本数学工具和现实中的例子。

在关于金融工具、市场和金融市场实践的问题上，书中做了适度的讨论。

我们通过简单的例子以非正式的方式来处理定价问题。

与此对比，书中在各种课题上强调了工程化的方法。

多年来，我从选我课程的注重实用技能的市场从业人士那里受益良多。

这些杰出的市场从业人士的深度知识和职业化为这本教材做出了重要贡献。

我还受惠于Marek Musiela与我关于本书中各种题目的讨论。

我的一些同事和学生阅读了初稿。

我要特别感谢Jiang Yi、Lu Yinqui、Andrea Lange、Lucas Bernard、Inas Reshad以及一些匿名审稿人，他们阅读了原稿并提供了建议。

本书使用了来自市场实践中的各种实际素材作为例子。

我要对《国际金融评论》(IFR)和《衍生品周刊》允许使用这些素材表示感谢。

所有遗留的错误当然由我承担。

本书的勘误表和其他相关材料将会放在网页[www.neftci.com](http://www.neftci.com)上，并会定期更新。

大量的努力融入了这本书。

我本可以讨论的一些更深入的问题不得被省略掉了，我打算将其加进以后的新版当中。

未来的新版还将更新书中使用的来自现实当中的素材。

## <<金融工程原理>>

### 内容概要

本书是被誉为与约翰 C. 赫尔的《期权、期货及其他衍生产品》一样具有很强操作性的金融工程入门畅销教材。

作者内夫茨将金融市场运作实际、金融工程理论和实践的最新发展密切结合，全面地介绍了金融工程原理和实际应用，并用许多图表、合同方程等直观方法，将复杂的数学理论简化，精心地描述了静态和动态环境下综合创造各种资产的方法，特别是对常见衍生品及有关金融工具的合成方法和技术进行了详尽的分析。

全书在各章后均有练习和案例研究，可进一步加强读者的理解和实际运用能力。

该书可作为大学本科生、研究生金融工程的入门教材，也适合金融市场从业人员及相关专业的人士参考。

书籍目录

出版说明 编委会 总序 序言 第1章 引论第2章 概念与定义第3章 现金流工程与远期合约第4章 简单利率衍生品工程 第5章 互换工程引论 第6章 金融工程中的回购市场策略第7章 动态复制方法与合成第8章 期权的交易机制第9章 凸度头寸工程第10章 期权工程及其应用第11章 金融工程中的定价工具第12章 基本定理的某些应用 第13章 固定收益工程第14章 波动率工程、波动率互换和波动率交易的各种工第15章 作为一类资产的波动性微笑第16章 信用市场：信用违约互换工程 第17章 结构化产品工程初步第18章 信用指数及其额度第19章 违约相关性定价与交易 第20章 本金保护技术 第21章 利率上限/下限与互换期权在抵押贷款上的应用第22章 权益工具工程：定价与复制 参考文献

## 章节摘录

插图：This chapter takes a step back and reviews in a nutshell the prerequisite for studying the methods of financial engineering. Readers with a good grasp of the conventions and mechanics of financial markets may skip it, although a quick reading would be preferable. Financial engineering is a practice and can be used only when we define the related environment carefully. The organization of markets, and the way deals are concluded, confirmed, and carried out, are important factors in selecting the right solution for a particular financial engineering problem. This chapter examines the organization of financial markets and the way market practitioners interact. Issues related to settlement, to accounting methods, and especially to conventions used by market practitioners are important and need to be discussed carefully. In fact, it is often overlooked that financial practices will depend on the conventions adopted by a particular market. This aspect, which is relegated to the background in most books, will be an important parameter of our approach. Conventions are not only important in their own right for proper pricing, but they also often reside behind the correct choice of theoretical models for analyzing pricing and risk management problems. The way information is provided by markets is a factor in determining the model choice. While doing this, the chapter introduces the mechanics of the markets, instruments, and who the players are. A brief discussion of the syndication process is also provided. The first distinction is between local and Euro markets. Local markets are also called onshore markets. These denote markets that are closely supervised by regulators such as central banks and financial regulatory agencies. There are basically two defining characteristics of onshore markets. The first is reserve requirements that are imposed on onshore deposits. The second is the formal registration process of newly issued securities. Both of these have important cost, liquidity, and taxation implications. In money markets, reserve requirements imposed on banks increase the cost of holding onshore deposits and making loans. This is especially true of the large "wholesale" deposits that.

<<金融工程原理>>

编辑推荐

《金融工程原理(英文版·原书第2版)》是21世纪经典原版经济管理教材文库之一。

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>