

<<金融工程>>

图书基本信息

书名：<<金融工程>>

13位ISBN编号：9787300054247

10位ISBN编号：7300054242

出版时间：2004-7

出版时间：中国人民大学出版社

作者：基思·卡思伯森等著、张陶伟等译

页数：649

字数：1043000

译者：基思·卡思伯森

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>

## 内容概要

本书详细讨论了期货，“普通香草型”期权、互换，以及在投机和对冲中对奇异衍生品和利率期权的使用。

在期权定价方面，除了阐述连续时间数学的解法外，还介绍了使用网格的数值方法（BOPM）、蒙特卡罗模拟和有限差分方法。

实物期权理论和它在投资估值以及对生物和互联网公司定价中的应用，具有有效的实践意义。

本书为衍生品和风险管理的课程而设计，适用于金融MBA、金融学硕士或者本科学。

本书可以单独学习，也可以作为本书作者写的另外一本书《投资学——现货和衍生品市场》的后续课程。

本书主要介绍了在投机、对冲及套利过程中金融衍生品的应用实务以及评价市场变化及全球金融机构信用风险的方法。

该书逻辑性强，层次清晰，体例灵活，适合大专院校本科生及研究生学习使用，也可供金融部门专业人士使用。

## 作者简介

基思·卡思伯森，帝国理工大学中管理学院的金融学教授。  
曾是英格兰银行和英国财政部的顾问，也是美联储的观察员。  
曾任教于纽卡斯尔大学和城市大学商学院，并为金融机构提供咨询。

德克·尼奇，帝国理工大学中管理学院的金融学讲师。  
他也是城市大学商学院的客座讲师。

书籍目录

第1部分 衍生品：概述 第1章 衍生证券：概述第2部分 远期和期货 第2章 期货市场 第3章 股票指数期货 第4章 货币远期和期货 第5章 短期利率期货 第6章 长期国债期货第3部分 期权和互换 第7章 期权市场 第8章 期权定价 第9章 对冲与波动率 第10章 期权价差与股票期权 第11章 外汇期权 第12章 期货期权 第13章 组合保险 第14章 互换第4部分 高级衍生品和随机过程 第16章 复合衍生品 第17章 资产价格动力学 第18章 利率衍生证券的定价 第19章 实物期权第5部分 风险和监管 第10章 对金融机构的监管 第21章 英国和美国的监管体系 第22章 市场风险 第23章 VaR：映射现金流 第24章 VaR：统计性问题 第25章 信用风险

#### 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>