

<<金融工程>>

图书基本信息

书名：<<金融工程>>

13位ISBN编号：9787300064109

10位ISBN编号：7300064108

出版时间：2005-6

出版时间：中国人民大学出版社

作者：林清泉

页数：403

字数：471000

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>

<<金融工程>>

内容概要

从本书的框架来看，共由四篇组成：金融工程概述篇、金融工程理论篇、金融衍生产品篇和金融工程技术与管理篇。

金融工程概述篇主要介绍了金融工程的定义和分析方法、金融工程的产生和发展以及主要金融衍生产品（如远期、期货、期权和互换）的基础知识。

金融工程理论篇是本书的核心部分，主要介绍了资产组合理论、资产定价模型、有效市场理论、无套利分析方法和MM定理、期权及二叉树模型、布莱克—斯科尔斯期权定价理论。

金融衍生产品篇是以金融衍生产品不同的标的资产为分类标准，并由此分别介绍以货币为基础的衍生产品、以利率为基础的衍生产品和以权益为基础的衍生产品。

金融工程技术与管理篇的内容包括：汇率风险管理、股票风险管理、利率风险管理、信用风险管理和风险价值测算以及期权思想在公司财务中的应用，主要介绍了可转换债券、股票期权以及实物期权。

作者简介

林清泉，中国人民大学财政金融学院教授、博士生导师，现任中国人民大学货币金融副主任。先后获得四川大学学士学位、华中理工大学硕士学位、中国科学院博士学位，随后进入山东大学金融高级人才培养基地，从事金融工程、金融数学的博士后研究，并参加国家自然科学基金委员会组

<<金融工程>>

书籍目录

第一篇 金融工程概述篇 第一章 金融工程概述 第一节 金融工程的界定 第二节 金融工程的分析 第三节 金融工程和金融创新 第二章 金融工程的产生和发展 第一节 从金融学到金融工程学 第二节 金融工程发展的因素 第三节 金融工程的发展趋势 第四节 金融工程在中国的发展 第三章 金融工程和金融风险管理 第一节 金融工程和金融风险管理 第二节 金融风险管理的新工具——金融衍生工具 第二篇 金融工程理论篇 第四章 资产组合理论 第一节 传统的资产组织管理和现代资产组合理论 第二节 马克维茨的资产组合理论 第三节 单指数模型 第五章 资本资产定价理论 第一节 资本资产定价模型 第二节 套利定价模型 第六章 有效市场理论 第一节 有效市场假设概述 第二节 有效市场假设下的投资管理 第三节 有效市场假设的实证检验 第四节 研究市场有效性的重要方法——事件研究 第五节 我国股市有效性的游程检验 第七章 无套利分析方法 第八章 期权的损益及二叉树模型 第九章 期权定价公式及其应用 第三篇 金融衍生产品篇 第十章 以货币为基础的衍生工具 第十一章 以利润为基础的衍生工具 第十二章 以权益为基础的衍生工具 第四篇 金融工程技术与管理篇 第十三章 汇率风险管理 第十四章 利率风险管理 第十五章 股票价格风险管理 第十六章 信用风险管理 第十七章 风险价值VAR的测算 第十八章 期权思想在企业中的应用 参考文献

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>