

<<金融工程学>>

图书基本信息

书名：<<金融工程学>>

13位ISBN编号：9787301182734

10位ISBN编号：7301182732

出版时间：2012-9

出版时间：北京大学出版社

作者：李淑锦

页数：227

字数：345000

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

《21世纪全国高等院校财经管理系列实用规划教材：金融工程学》对金融工程、风险、金融衍生工具、投机、套期保值、套利、定价原理等重要的核心范畴和内容进行了全面系统的阐述。

全书共分为3大模块：期货模块、期权模块和其他衍生产品模块。

每一模块内容的介绍遵循由简单到复杂，由交易原理到定价技术的顺序。

第1章简要介绍金融工程的概念及其在实际生活中的应用，介绍了基本的金融衍生工具；第2~4章是期货模块，介绍远期和期货的交易原理及其定价理论；第5~8章是期权模块，介绍期权的交易原理及其定价理论，以及期权的敏感性分析及其动态套期保值原理；第9~10章是其他衍生产品模块，讲述互换的交易原理、定价以及互换在实践中的应用，介绍一些其他的衍生产品、定价理论与应用。

《21世纪全国高等院校财经管理系列实用规划教材：金融工程学》强调金融工程知识的应用性，注重理论模型的严谨性，配有大量丰富且贴近现实的分析案例，还有进一步深化知识的阅读材料。本书除可用作高等院校金融学、金融工程、工商管理等专业的大学生和研究生的教材外，还可作为金融机构从业人员的培训教材及相关领域研究人员、行业监管人员的参考书。

## &lt;&lt;金融工程学&gt;&gt;

## 书籍目录

## 第1章 金融工程概述

- 1.1 金融工程的定义
- 1.2 金融工程在实际生活中的应用
- 1.3 金融创新的动因及其金融衍生工具产生的前提条件
- 1.4 最基本的衍生工具

本章小结

练习题

阅读材料

## 第2章 期货与期货市场

- 2.1 期货交易的产生
- 2.2 期货市场的制度性特征
  - 2.2.1 集中交易和统一清算
  - 2.2.2 标准化的期货合约
  - 2.2.3 结清期货头寸
  - 2.2.4 保证金制度和每日盯市结算制度
  - 2.2.5 其他相关的交易制度
  - 2.2.6 期货报价与行情表解读
- 2.3 期货合约的种类
- 2.4 期货的功能
  - 2.4.1 价格发现
  - 2.4.2 规避价格风险
- 2.5 期货的应用
  - 2.5.1 投机
  - 2.5.2 套期保值
- 2.6 中国的期货市场
  - 2.6.1 商品期货市场
  - 2.6.2 金融期货市场

本章小结

练习题

阅读材料

## 第3章 金融期货交易

- 3.1 利率期货
  - 3.1.1 短期利率期货
  - 3.1.2 中长期利率期货合约
  - 3.1.3 利率期货的运用
- 3.2 外汇期货
  - 3.2.1 外汇期货的概念
  - 3.2.2 外汇期货的合约规格
  - 3.2.3 外汇期货的运用
- 3.3 股指期货
  - 3.3.1 股指简介
  - 3.3.2 世界著名股价指数简介
  - 3.3.3 股价指数期货合约
  - 3.3.4 股指期货的运用

本章小结

## &lt;&lt;金融工程学&gt;&gt;

练习题

阅读材料

#### 第4章 远期和期货的定价

##### 4.1 无套利定价理论

##### 4.2 远期价格和期货价格的关系

###### 4.2.1 基本假设

###### 4.2.2 使用的符号

###### 4.2.3 远期价格和期货价格的关系

##### 4.3 无收益资产远期合约的价格

###### 4.3.1 现货远期平价公式

###### 4.3.2 远期价格的期限结构

##### 4.4 支付已知现金收益资产的远期合约的价格

##### 4.5 支付已知收益率资产远期合约的价格

###### 4.5.1 一般的现货——远期平价公式

###### 4.5.2 外汇远期和期货的定价

本章小结

练习题

阅读材料

#### 第5章 期权与期权市场

##### 5.1 期权的基本概念

##### 5.2 期权的分类

###### 5.2.1 不同标的资产的期权合约

###### 5.2.2 常规期权和奇异期权

###### 5.2.3 有担保的期权和无担保的期权

###### 5.2.4 场内期权和场外期权

##### 5.3 期权市场

###### 5.3.1 期权交易所的标准化合约及其相关规定

###### 5.3.2 基本交易制度

###### 5.3.3 交易所的清算制度

###### 5.3.4 主要的期权交易所

本章小结

练习题

阅读材料

#### 第6章 期权组合交易策略及盈亏分析

##### 6.1 基本的期权交易策略及其盈亏分析

###### 6.1.1 买方看涨期权与卖方看涨期权

###### 6.1.2 买方看跌期权与卖方看跌期权

##### 6.2 期权组合交易策略与盈亏分析

###### 6.2.1 混合期权

###### 6.2.2 差价期权

##### 6.3 期权组合盈亏图的算法

本章小结

练习题

阅读材料

#### 第7章 期权定价理论

##### 7.1 期权价格的影响因素

###### 7.1.1 内在价值和时间价值

## &lt;&lt;金融工程学&gt;&gt;

- 7.1.2 期权价格的影响因素
- 7.2 期权价格的上下界及其相互关系
  - 7.2.1 有效期内无收益标的资产的欧式期权的上下界
  - 7.2.2 有效期内无固定收益标的资产的欧式期权价格的上下界
  - 7.2.3 无收益标的资产的美式期权价格的上下界
  - 7.2.4 有固定收益标的资产的美式期权价格的上下界
  - 7.2.5 欧式看涨和看跌期权的平价关系
- 7.3 期权价格曲线
  - 7.3.1 看涨期权的价格曲线
  - 7.3.2 看跌期权的价格曲线
- 7.4 二叉树期权模型
  - 7.4.1 二叉树的一期模型
  - 7.4.2 一般的二叉树期权模型
- 7.5 B-S期权定价模型
  - 7.5.1 基本假定
  - 7.5.2 基础知识
  - 7.5.3 B-S微分方程
  - 7.5.4 B-S期权定价公式及其拓展
- 本章小结
- 练习题
- 阅读材料
- 第8章 期权价格的敏感性因素分析及其动态套期保值
  - 8.1 Delta、Gamma、Rho、Vega、Theta
  - 8.2 期权套期保值的基本原理
  - 8.3 期权的动态套期保值策略
- 本章小结
- 练习题
- 阅读材料
- 第9章 金融互换理论
  - 9.1 互换市场的起源与发展
  - 9.2 最基本的互换品种
    - 9.2.1 互换原理
    - 9.2.2 最基本的互换合约
  - 9.3 利率互换的定价
    - 9.3.1 零息票定价法
    - 9.3.2 运用债券组合给利率互换定价
  - 9.4 货币互换的定价
  - 9.5 互换的基本应用
- 本章小结
- 练习题
- 阅读材料
- 第10章 其他衍生产品
  - 10.1 远期价格
  - 10.2 远期利率协议
  - 10.3 综合的远期外汇协议
- 本章小结

<<金融工程学>>

练习题  
阅读材料  
参考文献

编辑推荐

《21世纪全国高等院校财经管理系列实用规划教材：金融工程学》特点： 1. 科学实用：面向应用型人才就业，具备大量当前实用案例，注重培养学生实践能力 2. 内容新颖：借鉴国内外最新教材，融会当前最新理论，遵循最新发布各项准则、规范 3. 系列完整：把握财经管理专业相关学科、课程之间的关系，整个系列体系严密完整 4. 方便教学：网上 (<http://www.pup6.cn>)提供完备的电子教案、习题参考答案等教学资源，适合教学需要 以金融产品的应用和定价为主线 注重金融衍生产品在实际中的运用 降低数学推导难度并精选例题分析

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>