

<<期权、期货和其他衍生品>>

图书基本信息

书名：<<期权、期货和其他衍生品>>

13位ISBN编号：9787302190264

10位ISBN编号：7302190267

出版时间：2009-3

出版时间：清华大学出版社

作者：约翰·赫尔

页数：785

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>

<<期权、期货和其他衍生品>>

前言

## <<期权、期货和其他衍生品>>

### 内容概要

《清华金融学系列英文版教材：期权、期货和其他衍生品（第6版）》是一本在西方金融界广泛流传的名著，被誉为“华尔街的圣经”。

衍生品理论在现代金融学中占有核心地位。

衍生品理论（尤其是期权定价理论）的提出，不但建立了金融经济学的基本理论框架，而且在理论的指导下推动了期货、期权、互换等市场的发展，使金融在全球范围内发展到今天如此巨大的规模。

《清华金融学系列英文版教材：期权、期货和其他衍生品（第6版）》全面系统地讲解了衍生品定价与金融风险管理的基本理论和方法。

在本版中，作者不仅增加了一些新内容，而且对一些议题和章节进行了重新编写，使全文更易于阅读和讲解。

通过阅读本书，读者可以系统掌握现代金融学的核心理论和基本方法，尤其是对有志于学习金融工程和投身于资本市场业务的人来说，是非常有价值的。

《清华金融学系列英文版教材：期权、期货和其他衍生品（第6版）》可作为大专院校金融学及相关专业的本科生和研究生的教学用书，也可供金融业界人士用作业务手册以备查阅。

## <<期权、期货和其他衍生品>>

### 作者简介

作者：(加拿大)约翰·赫尔 (John Hull) 约翰·赫尔 (John Hull)，加拿大多伦多大学罗特曼管理学院 (Joseph L. Rotman School of Management) 教授，Bonham金融中心主任。

国际公认的衍生品理论权威，发表了多部相关著作。

Hull教授与Alan White因为在Hull—white利率模型上的工作赢得Nikko—LOR研究竞赛。

他是八家学术杂志的联合编辑，曾任北美、日本和欧洲多家金融机构的顾问。

Hull教授所著的两本书《期权、期货和其他衍生品》与《期货与期权市场基本原理》被翻译成多种文字，并在全世界广泛流行。

他曾获得多个教学奖，包括多伦多大学享有盛誉的诺斯洛普弗莱奖 (Northrop Frye award)，并于1999年被国际金融工程师协会评选为年度金融工程师。

Hull博士还曾在约克大学、不列颠哥伦比亚大学、纽约大学、格连菲尔德大学、伦敦商学院任教。

## &lt;&lt;期权、期货和其他衍生品&gt;&gt;

## 书籍目录

第1章 绪论1.1 场内交易市场1.2 场外交易市场1.3 远期合约1.4 期货合约1.5 期权1.6 交易者的类型1.7 套期保值者1.8 投机者1.9 套利者1.10 危险小结参考读物问题和习题课后练习第2章 期货市场的机制2.1 背景2.2 期货合约的设定2.3 期货价格向现货价格的收敛2.4 每日结算和保证金2.5 报纸上的价格行情2.6 交割2.7 交易者和订单的类型2.8 监管2.9 会计及税收2.10 远期合约与期货合约小结参考读物问题和习题课后练习第3章 期货的套期保值策略3.1 基本原则3.2 赞成和反对套期保值的论点3.3 基差风险3.4 交叉套期保值3.5 股票指数期货3.6 展期小结参考读物问题和习题课后练习附录 最小方差套期保值比率公式的证明第4章 利率4.1 利率的类型4.2 利率测算4.3 零息票利率4.4 债券定价4.5 国库券零息票利率的计算4.6 远期利率4.7 远期利率协议4.8 久期4.9 凸性4.10 利率期限结构理论小结参考读物问题和习题课后练习第5章 远期和期货价格的确定5.1 投资性资产与消费性资产5.2 卖空5.3 假设和符号5.4 投资性资产的远期价格5.5 已知收益5.6 已知红利率5.7 估计远期合约的价值5.8 远期价格与期货价格是否相等5.9 股票指数期货的价格5.10 外汇的远期和期货合约5.11 商品期货5.12 持有成本5.13 交割选择权5.14 期货价格和预期将来的即期价格小结参考读物问题和习题课后练习附录 证明利率不变时远期价格与期货价格相等第6章 利率期货6.1 日期计算惯例6.2 国债报价6.3 国债期货6.4 欧洲美元期货6.5 基于久期的套期保值策略6.6 对资产负债组合进行套期保值小结参考读物问题和习题课后练习第7章 互换7.1 利率互换的机制7.2 日期计算问题7.3 确认书7.4 比较优势的观点7.5 互换率的本质7.6 LIBOR / (互换)零息票利率的计算7.7 利率互换的估价7.8 货币互换7.9 货币互换的估价7.10 信用风险7.11 其他类型的互换小结参考读物问题和习题课后练习第8章 期权市场的机制8.1 期权类型8.2 期权头寸8.3 标的资产8.4 股票期权的性质8.5 报纸上的期权行情8.6 交易8.7 佣金8.8 保证金8.9 期权结算公司8.10 监管8.11 税收8.12 认股权证、管理层股票期权和可转换债券8.13 场外交易市场小结参考读物问题和习题课后练习第9章 股票期权的性质9.1 影响期权价格的因素9.2 假设和符号9.3 期权价格的上下限9.4 看跌期权与看涨期权之间的平价关系9.5 提前执行：不付红利股票的看涨期权9.6 提前执行：不付红利股票的看跌期权9.7 红利的影响小结参考读物问题和习题课后练习第10章 期权的交易策略10.1 包括一个期权和一个股票的策略10.2 差价期权10.3 组合期权10.4 其他复合期权的损益状态.....第11章 二叉树模型第12章 维纳过程与引理第13章 Black Scholes Merton模型第14章 股票指数期权、货币期权和期货期权第15章 希腊字母第16章 波动率微笑第17章 基本数值方法第18章 风险值第19章 估计波动率与相关性第20章 信用风险第21章 信用衍生品第22章 奇异期权第23章 天气、能源和保险衍生证券第24章 更多的模型与数值方法第25章 鞅和测度第26章 利率衍生品：标准的市场模型第28章 税率衍生品：瞬时利率模型第29章 利率衍生品：HJM和LMM第30章 互换第31章 实物期权第32章 衍生品灾难以及我们能从中学到什么术语表主要的期货与期权交易所

<<期权、期货和其他衍生品>>

章节摘录

插图：

<<期权、期货和其他衍生品>>

编辑推荐

《期权、期货和其他衍生品(第6版)》可作为大专院校金融学及相关专业的本科生和研究生的教学用书, 也可供金融业界人士用作业务手册以备查阅。

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>