

<<期权、期货和衍生证券>>

图书基本信息

书名：<<期权、期货和衍生证券>>

13位ISBN编号：9787508011929

10位ISBN编号：7508011929

出版时间：1997

出版时间：华夏出版社

作者：(美)约翰.赫尔

译者：张陶伟

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、期货和衍生证券>>

书籍目录

目录	
前言	
第一章 介绍	
1.1 远期合约	
1.2 期货合约	
1.3 期权	
1.4 其它衍生证券	
1.5 交易者的类型	
1.6 小结	
第二章 期货市场和期货合约套期保值应用	
2.1 期货合约的交易	
2.2 期货合约的特性	
2.3 保证金的操作	
2.4 报纸行情	
2.5 期货价格收敛于现货价格	
2.6 现金结算	
2.7 利用期货套期保值	
2.8 最佳套期比率	
2.9 向前延展的套期保值	
2.10 小结	
第三章 远期和期货价格	
3.1 某些预备知识	
3.2 无收益证券的远期合约	
3.3 支付已知现金收益证券的远期合约	
3.4 支付已知红利率证券的远期合约	
3.5 一般结论	
3.6 远期价格和期货价格	
3.7 股票指数期货	
3.8 货币的远期和期货合约	
3.9 商品期货	
3.10 持有成本	
3.11 交割选择	
3.12 期货价格和预期将来的即期价格	
3.13 小结	
附录3A：当利率为常数时，远期价格与期货价格相等的一个证明	
第四章 利率期货	
4.1 某些预备知识	
4.2 长期和中期国债期货	
4.3 短期国债期货	
4.4 欧洲美元期货	
4.5 久期	
4.6 基于久期的套期保值策略	
4.7 久期的局限性	
4.8 小结	

<<期权、期货和衍生证券>>

第五章 互换

- 5.1 利率互换的机制
- 5.2 利率互换的定价
- 5.3 货币互换
- 5.4 货币互换的定价
- 5.5 其它互换
- 5.6 信用风险
- 5.7 小结

第六章 期权市场

- 6.1 期权交易所
- 6.2 场外交易的期权
- 6.3 期权合约的性质
- 6.4 报纸上的期权行情
- 6.5 交易
- 6.6 保证金
- 6.7 期权清算公司
- 6.8 认股权证和可转换债券
- 6.9 小结

第七章 股票期权价格的特征

- 7.1 影响期权价格的因素
- 7.2 假设和符号
- 7.3 期权价格的上下限
- 7.4 提前执行：不付红利股票的看涨期权
- 7.5 提前执行：不付红利的看跌期权
- 7.6 看跌与看涨期权之间平价关系
- 7.7 红利的影响
- 7.8 实证研究
- 7.9 小结

第八章 期权的交易策略

- 8.1 包括一个简单期权和一个股票的策略
- 8.2 差价期权
- 8.3 组合期权
- 8.4 其他复合期权的损益状态
- 8.5 小结

第九章 股票价格行为的一种模式

- 9.1 马尔科夫性质
- 9.2 维纳过程
- 9.3 股票价格的行为过程
- 9.4 模型回顾
- 9.5 参数
- 9.6 二叉树模型
- 9.7 小结

第十章 Black - Scholes模型的分析

- 10.1 ITO定理
- 10.2 股票价格的对数正态分布特性
- 10.3 收益率的分布
- 10.4 从历史数据估计的波动率

<<期权、期货和衍生证券>>

- 10.5利用简单二叉树模型对期权定价
- 10.6Black - Scholes微分方程的基本概念
- 10.7Black - Scholes微分方程的推导
- 10.8风险中性定价
- 10.9Black - scholes定价公式
- 10.10累积正态分布函数
- 10.11公司发行的本公司股票认股权证
- 10.12隐含波动率
- 10.13波动率产生的原因
- 10.14红利
- 10.15小结
- 附录10A：ITO 定理的推导
- 附录10B：计算基于支付红利股票的美式看涨期权价值的精确步骤
- 第十一章 股票指数期权、货币期权和期货期权
- 11.1支付已知红利股票的期权
- 11.2股票指数期权
- 11.3货币期权
- 11.4期货期权
- 11.5小结
- 附录11A：基于支付连续红利率股票衍生证券所满足的微分方程的推导
- 附录11B：基于期货价格衍生证券所满足的微分方程的推导
- 第十二章 衍生证券定价的一般性方法
- 12.1单一基本变量
- 12.2利率风险
- 12.3基于几个状态变量的证券
- 12.4基于商品价格的衍生证券
- 12.5交叉货币期货和期权
- 12.6小结
- 附录12A：ITO 定律的一般表示式
- 附录12B：推导衍生证券所满足的一般微分方程
- 第十三章 期权与其它衍生证券的保值
- 13.1一个例子
- 13.2裸期权头寸与抵补期权头寸
- 13.3止损策略
- 13.4更复杂的保值策略
- 13.5Delta套期保值
- 13.6Theta
- 13.7Gamma
- 13.8Delta, Theta和Gamma之间的关系
- 13.9Vega
- 13.10RHO
- 13.11实际中的期权组合套期保值
- 13.12有价值证券组合的保险
- 13.13小结
- 附录13.A 台劳展开和对冲参数

<<期权、期货和衍生证券>>

第十四章 数值方法

- 14.1 蒙特卡罗模拟
- 14.2 二叉树
- 14.3 指数期权、货币期权和期货期权的二叉树法
- 14.4 支付已知红利的股票期权的二叉树法
- 14.5 基本二叉树方法的扩展
- 14.6 避免负的概率
- 14.7 有限差分方法
- 14.8 期权定价的解析近似方法
- 14.9 小结

附录14A：MAC MILKAN，BARONE - ADESI和WHALEY
的美式期权价格的解析近似方法

第十五章 利率衍生证券

- 15.1 交易所内的债券期权
- 15.2 嵌入债券的期权
- 15.3 有抵押的证券
- 15.4 互换期权
- 15.5 利率上限
- 15.6 债券期权估值的简单方法
- 15.7 简单模型的局限性
- 15.8 研究人员构造期限结构所采用的传统方法
- 15.9 Rendleman和Bartter模型
- 15.10 均值回复
- 15.11 Vasicek模型
- 15.12 Cox，Ingersoll和Ross模型
- 15.13 两因素模型
- 15.14 无套利模型
- 15.15 Heath，Jarrow和Morton 方法
- 15.16 Ho和Lee模型
- 15.17 Hull和White模型
- 15.18 套期保值
- 15.19 小结

第十六章 新型期权

- 16.1 新型期权的类别
- 16.2 基本定价工具
- 16.3 美式路径依赖型期权
- 16.4 基于两个相关资产的期权
- 16.5 套期保值讨论
- 16.6 小结

第十七章 Black - Scholes期权定价的几种方法

- 17.1 利率和波动率变化已知的修正
- 17.2 Merton随机利率模型
- 17.3 偏差的定价
- 17.4 几个模型
- 17.5 定价偏差的回顾
- 17.6 实证研究
- 17.7 在实际中如何利用这些模型

<<期权、期货和衍生证券>>

17.8小结

附录17A：几个模型的定价公式

第十八章 信用风险

18.1资产暴露的性质

18.2确定资产的合约

18.3可能是资产或负债的合约

18.4国际清算银行的资本充足要求

18.5减少违约风险

18.6小结

第十九章 关键概念的回顾

19.1无风险的套期保值

19.2可交易证券和其它标的变量

19.3风险中性化定价

19.4 结束语

附表：当 $X \rightarrow 0$ 时 $N(x)$ 表

附表：当 $X \rightarrow 0$ 时 $N(X)$ 表

世界交易所名称

各种符号的总结

注释

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>