

<<金融工程学>>

图书基本信息

书名：<<金融工程学>>

13位ISBN编号：9787810980456

10位ISBN编号：7810980459

出版时间：2004-2-1

出版时间：上海财经大学出版社

作者：周洛华

页数：212

字数：303000

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>

## 前言

《金融工程学》于2004年首次出版之后，得到了学界和业界的认可，被多所院校选作教材，并于2008年初入选教育部全国普通高等教育“十一五”国家级规划教材。

对此，我深感荣幸。

最近，出版社的同志邀请我对原书进行修订再版，我感到很高兴。

这是因为从首次出版至今，中国资本市场发生了许多重大的变化。

我们推进了股权分置改革，迎来了全流通的时代；我们还将推出股指期货和期权等新交易品种，迎来对冲交易的时代。

我们从改善公司治理结构和提高上市公司质量入手，落实国务院关于发展中国资本市场的九条意见。我记得在撰写第一版《金融工程学》时，上证指数还在1000点左右的低位徘徊，而到修订再版之时，上证指数最高曾创出6000点的历史新高。

沪深两市的日均交易额从每天不到100亿元人民币，上升到2007年的近3000亿元，一举超过纽约证券交易所，成为全球第一大交易额资本市场。

这些翻天覆地的变化给金融工程学带来了更多的应用空间，也使得我在修订过程中，可以用更新的案例来充实和丰富这本教科书。

修订工作完成之后，我又仔仔细细地把全书阅读了一遍。

“真是一本好书啊！”合上书稿，我心里这样想着，同时我又有了这样一个问题：“为什么我读书那会儿，没有这样好的教材呢？”这是因为金融学在实践中大踏步地前进和发展，自闭于书斋中的学者很难感受到这些年来中国资本场所取得的狂飙急进式的成果。

令我感到尴尬和惋惜的是：我自己在学生时代的大多数时间都在应付下一次考试，而不是在准备下一次实践。

我相信许多人都有类似经历所造成的遗憾，究其原因，恐怕不仅与传统的、以考试为中心的教育体制有关，也与教材编写者脱离实际工作有关。

因此，在撰写和修订《金融工程学》过程中，我没有把读者当成学生，而是视作即将踏上工作岗位的金融从业人员，是我未来的同事们。

我迫切地感觉到：我有责任把中国资本市场的真实情况介绍给你们，把我自己的实践经验在这里转告给你们：金融学没有对和错，只有输和赢。

你们来到资本市场，不是为了构建模型，而是为了创造价值。

## <<金融工程学>>

### 内容概要

本书重实践而不重理论，全书侧重于金融工程学的思想方法和应用实例，而不拘泥于数学推导和求解过程。

全书基本上是将作者自己充分理解并在实践中印证的理论，按照一个新的框架写成的。

全书配合有许多生动的案例，也是作者这些年来仔细收录的，相信对读者会有所启发。

本书重实践而不重理论，全书侧重于金融工程学的思想方法和应用实例，而不拘泥于数学推导和求解过程。

全书基本上是将作者自己充分理解并在实践中印证的理论，按照一个新的框架写成的。

全书配合有许多生动的案例，也是作者这些年来仔细收录的，相信对读者会有所启发。

#### 作者简介

周洛华 上海社会科学院世界经济研究所经济学博士，美国Dartmouth学院Tuck商学院金融战略博士后研究员，在美国一流学府从事资产定价、波动率分析的研究。著有《信息时代的创新及其发展效益》等。

## &lt;&lt;金融工程学&gt;&gt;

## 书籍目录

前言 第一章 金融工程学导论 第一节 传统金融学的主要研究内容 第二节 金融工程学的发展 第三节 金融工程学的基本框架 第四节 金融工程学的应用范畴 第二章 金融市场 第一节 有效金融市场 第二节 有效证券组合理论 第三节 M&M定理及其意义 第四节 金融市场与价值创造 第三章 资产定价 第一节 资本资产定价模型 第二节 套利定价模式 第三节 项目的价值分析 第四节 资产定价模型的局限性和应用 第四章 金融工具 第一节 金融工具 第二节 金融工具的头寸 第三节 金融工具的头寸组合和头寸 第四节 选择金融工具 第五章 债券 第一节 债券概述 第二节 债券的期限结构 第三节 债券的风险管理 第四节 推广与应用 第六章 期货和远期 第一节 期货和远期概述 第二节 期货和远期的定价 第三节 期货和远期的交易 第四节 期货和远期的应用 第七章 期权 第一节 期权概述 第二节 期权定价法 第三节 期权投资法 附录 美式期权的定价 第八章 实物期权 第一节 实物期权概述 第二节 实物期权的应用方法 第三节 实物期权的应用领域 第四节 实物期权势缺陷 第九章 发现价值——在金融市场上的应用 第一节 互换交易 第二节 期权配合 第三节 金融资产的实物替代 附录 测量中国股市成熟度的一个实验 第十章 创造价值——金融工程的推广应用 第一节 能力创造价值 第二节 不确定性条件下的投资管理 第三节 企业的战略投资 第四节 企业的收购兼并 词汇表 参考文献

## 章节摘录

第一章 金融工程学导论 第一节 传统金融学的内容 我们国内大多数人初次接触金融学

时，所涉及的主要内容都属于国际金融学的范畴。

主要研究对象是外汇汇率、国际收支或者是货币政策。

而在国外的教学机构，这些问题都属于宏观经济学的范畴。

他们的学生初次接触的金融学往往偏重于微观企业的现实需要，以研究企业的财务管理问题入手，进而在投资学领域展开讨论。

事实上，以上两种不同的教学内容分别属于金融学的不同学科。

因此，极易造成一些名称上的误解。

比如：有关外汇汇率机制的问题在国外的教材中，属于金融市场学的范畴；有关外汇投机方法的问题属于套利研究的范畴；有关外汇交易工具的内容则被国外的学者归类于如何选择金融载体的范畴。

而在我国的高等院校，这些问题往往被统一编入国际金融学的内容。

有鉴于此，我们有必要在进入金融工程学领域之前，先将金融学的有关领域简略地叙述一番，以便读者对于金融工程学在整个金融学体系中所处的地位有所了解。

传统的金融学从微观和宏观两个方面都取得了长足的进步，在理论和实践两个方面都获得了不小的成就。

一般来说，传统的金融学研究领域大致有两个方向：宏观的金融市场运行理论和微观的资产定价理论。

编辑推荐

于2004年首次出版之后，得到了学界和业界的认可，被多所院校选作教材，并于2008年初入选教育部全国普通高等教育“十一五”国家级规划教材。

这是因为从首次出版至今，中国资本市场发生了许多重大的变化。推进了股权分置改革，迎来了全流通的时代；我们还将推出股指期货和期权等新交易品种，迎来对冲交易的时代。

我们从改善公司治理结构和提高上市公司质量入手，落实国务院关于发展中国资本市场的九条意见。在撰写第一版《金融工程学》时，上证指数还在1000点左右的低位徘徊，而到修订再版之时，上证指数最高曾创出6 000点的历史新高。

沪深两市的日均交易额从每天不到100亿元人民币，上升到2007年的近3 000亿元，一举超过纽约证券交易所，成为全球第一大交易额资本市场。

这些翻天覆地的变化给金融工程学带来了更多的应用空间，也使得我在修订过程中，可以用更新的案例来充实和丰富《金融工程学》（第2版）。

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>