

<<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>