第一图书网, tushu007.com

<<金融工程理论与应用>>

图书基本信息

书名：<<金融工程理论与应用>>

13位ISBN编号：9787302277125

10位ISBN编号：7302277125

出版时间：2012-2

出版时间：清华大学出版社

作者：朱顺泉

页数：256

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

内容概要

《普通高校“十二五”规划教材·金融学系列：金融工程理论与应用》的主要内容包括：①金融工程导论；②远期合约、期货合约及其定价；③期货合约的套期保值；④多品种期货情况下的最优套期保值模型及其应用；⑤互换合约及其定价；⑥期权与二项式期权定价模型及其应用；⑦Black-Scholes期权定价模型的推导；③Black-Scholes期权定价模型与应用；⑨Black-Scholes期权定价模型的隐含波动率；⑩期权定价的有限差分计算；⑩期权定价的蒙特卡罗模拟计算；⑥风险价值模型及其应用。

《普通高校“十二五”规划教材·金融学系列：金融工程理论与应用》可供金融工程、金融学、财务管理、会计学、统计学、信息管理与信息系统、技术经济及管理、应用数学等专业的本科高年级学生与研究生使用或参考；亦可作为有志于从事相关专业人士的参考用书。

书籍目录

第1章 金融工程导论1.1 金融工程的概念1.2 国际主流金融理论发展1.3 现代主流金融理论简介1.3.1 投资组合理论1.3.2 资本资产定价模型1.3.3 套利定价理论1.3.4 期权定价1.3.5 有效市场假说1.3.6 固定收益证券1.3.7 资本结构1.4 金融衍生产品与参与者1.5 风险中性定价法与无套利定价法思考题第2章 远期合约、期货合约及其定价2.1 远期合约及其定价2.1.1 远期合约的概念2.1.2 远期合约的定价2.2 期货合约及其定价2.2.1 期货合约的概念2.2.2 期货合约的定价思考题第3章 期货合约的套期保值3.1 期货的套期保值（或对冲）概念与实例3.2 期货的套期保值计算方法3.3 期货套期保值的基差和基差风险3.4 期货套期保值的利润和有效价格3.5 套期保值的套头比3.5.1 套头比的概念及计算方法3.5.2 直接套期保值套头比的计算模型3.5.3 交叉套期保值套头比的计算模型3.6 现货与期货方差和协方差计算模型及其应用3.7 不考虑费用的最优套期保值策略模型及其应用3.7.1 套期保值利润和方差的计算3.7.2 最低风险情况下的最优套期保值策略模型3.7.3 给定最低收益情况下的最优套期保值策略模型3.7.4 给定最高风险情况下的最优套期保值策略模型3.8 考虑费用的最优套期保值策略模型及其应用3.8.1 考虑费用的最优套期保值的利润和方差计算3.8.2 最低风险情况下的最优套期保值模型3.8.3 考虑费用的给定最低收益情况下的最优套期保值模型3.8.4 考虑费用的给定最高风险情况下的最优套期保值模型思考题第4章 多品种期货情况下的最优套期保值模型及其应用4.1 套期保值的原理与基本方法4.1.1 套期保值套头比的确定4.1.2 投资组合各个资产的最优投资比例的确定4.2 最优套期比的计算4.3 结果分析思考题第5章 互换合约及其定价5.1 互换合约的概念和分类5.2 利率互换的定价5.2.1 影响利率互换价值的因素5.2.2 利率互换的定价……第6章 期权与二项式期权定价模型及其应用第7章 Black-Scholes期权定价模型的推导第8章 Black-Scholes期权定价模型与应用第9章 Black-Scholes期权定价模型的隐含波动率第10章 期权定价的有限差分计算第11章 期权定价的蒙特卡罗模拟计算第12章 风险价值模型及其应用主要参考文献

第一图书网, tushu007.com

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