

<<财务工程学>>

图书基本信息

书名：<<财务工程学>>

13位ISBN编号：9787564202460

10位ISBN编号：7564202467

出版时间：2008-9

出版时间：上海财经大学出版社

作者：刘晓宏，张人骥 著

页数：324

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>

## <<财务工程学>>

### 内容概要

《高等院校精品课系列教材·上海财经大学财务管理专业系列教材?财务工程学》总结了以往在金融衍生产品、企业财务风险管理、企业财务战略等方面的教学和实践心得，结合企业财务管理实务，充分展示财务工程理论与方法精髓。

全书共十二章，系统介绍了金融衍生产品特性（包括远期、期货、互换、期权及其组合）、财务工程研究分析方法和技术（包括套期保值原理、风险中性定价原理等）；阐释风险作用原理，从企业视角着重讲述了风险管理的具体方法和程序；结合相关理论和实践最新发展成果，较为全面地介绍了财务工程工具与技术在企业投资、融资、税务筹划和资产重组中的系统运用。

最后，《高等院校精品课系列教材?上海财经大学财务管理专业系列教材?财务工程学》针对企业实践需要，特别介绍了金融工具会计的核心问题和我国新会计准则对金融工具确认、计量、列报和披露的主要要求。

## &lt;&lt;财务工程学&gt;&gt;

## 书籍目录

前言第一章 概述学习目标引导案例第一节 财务工程的概念及特征第二节 财务工程产生和发展的驱动力第三节 财务工程理论发展与分析技术第四节 金融衍生工具概述第五节 金融衍生产品在中国本章小结思考题第二章 远期学习目标引导案例第一节 远期合约概述第二节 远期合约的定价第三节 远期利率协议第四节 外汇远期第五节 远期的应用本章小结思考题第三章 期货学习目标引导案例第一节 期货合约概述第二节 期货市场制度安排第三节 期货价格第四节 期货的应用本章小结思考题第四章 指数期货学习目标引导案例第一节 指数期货概述第二节 指数期货的定价及交易策略第三节 指数期货的发展本章小结思考题第五章 利率期货学习目标引导案例第一节 利率期货概述第二节 利率期货的定价及交易策略第三节 利率期货的发展本章小结思考题第六章 互换学习目标引导案例第一节 互换概述第二节 利率互换第三节 货币互换第四节 互换的应用第五节 互换交易的信用风险本章小结思考题第七章 期权学习目标引导案例第一节 期权简述第二节 期权交易本章小结思考题第八章 期权交易策略学习目标引导案例第一节 期权交易策略第二节 奇异期权本章小结思考题第九章 期权定价学习目标引导案例第一节 期权价格性质第二节 B-S定价方法第三节 二叉树定价方法第四节 模拟方法本章小结思考题附录：股票价格的行为模式第十章 风险管理学习目标引导案例第一节 风险管理与企业价值的关系第二节 市场风险的种类第三节 风险敞口的识别第四节 企业金融价格风险的度量方法第五节 企业金融价格风险作用机制第六节 风险管理策略本章小结思考题第十一章 公司理财与财务工程学习目标引导案例第一节 财务工程在投资决策中的实践第二节 财务工程在融资决策中的实践第三节 财务工程在税收管理中的实践第四节 财务工程在资产重组中的实践第五节 其他用途本章小结思考题第十二章 金融工具会计学习目标引导案例第一节 金融工具会计概述第二节 金融工具的确认与计量第三节 金融资产转移第四节 套期保值第五节 金融工具列报本章小结思考题参考文献

## 章节摘录

第四章 指数期货 第二节 指数期货的定价及交易策略 投资者买卖股票时投资风险可分为系统性风险和非系统性风险，直接参与指数期货交易可使投资者能够避开对个别股票的投资决策，在参与整个股票市场的同时而不必拥有股票，省却了挑选股票的风险。指数期货还使套期保值的投资者能够通过股票现货市场与期货市场上的反向对冲交易，减少股市总体波动的风险暴露，从而成为投资者控制和防范股市总体风险的重要工具之一。此外，指数期货交易由于具有比股票买卖成本低和杠杆性高等优点，能够提高投资组合的收益率和增加投资组合的流动性，一经推出就受到投资者的热烈欢迎。

指数期货市场上主要存在着三类交易者：买卖者、套期保值者和套利者，这三类投资者为了实现各自的目的参与指数期货交易，从投资者结构分布来看，一般来说市场上指数期货的买卖交易者占的比例比较高，而套期保值和套利者所占的比例比较低。

指数期货投资策略中的核心问题是指数期货的定价问题。

我们从四个方面来分析指数期货的投资策略：（1）指数期货的定价研究；（2）指数期货的买卖交易；（3）指数期货的套期保值交易；（4）指数期货的套利交易。

一、定价模型 经研字中有个基本定律——“一价定律”，是说两份相同的资产在两个市场中的报价必然相同，否则一个市场参与者可以进行在一个市场中低价买进，同时在另一个市场中高价卖出的无风险套利，最终使得在原来定价低的市场中因对该资产需求增加而使其价格上涨，而原来定价高的市场中该资产价格会下跌，直至最后两个报价相同。

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>