

<<金融工程>>

图书基本信息

书名：<<金融工程>>

13位ISBN编号：9787040230239

10位ISBN编号：7040230232

出版时间：2008-7

出版时间：高等教育出版社

作者：郑振龙//陈蓉

页数：331

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&gt;&gt;

## 内容概要

本书第一版为教育部“新世纪高等教育教学改革工程——21世纪中国金融学专业教育教学改革与发展战略研究”项目的研究成果，是“高等教育百门精品课程教材建设计划”的一部分，是普通高等教育“十五”国家级规划教材，同时也是高等学校金融学专业主干课程教材。

第二版为普通高等教育“十一五”国家级规划教材，是国家精品课程“金融工程”的建设成果之一。

本书分为三大部分：第一章从发展历史、分析方法的角度介绍金融工程的一般知识；第二至十六章分别介绍远期、期货、互换和期权等主要金融衍生产品的基础知识、市场制度、定价和运用，具体又可分为远期和期货（第二至五章）、互换（第六至八章）、期权（第九至十六章）三个部分；第十七章则对现代金融风险管理的基础知识进行了介绍。

全书强调知识的应用性，注重理论模型的严谨性，配有大量丰富且贴近现实的案例解析。

本书可用作普通高等院校金融学、金融工程、工商管理等专业“金融工程”课程本科生和研究生教科书，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。

本书教学支持网络为<http://efinance.org.cn/fm.htm>，内有供学生使用的模拟实验软件，以及专供教师使用的教学课件和习题答案。

#### 作者简介

郑振龙，博士，厦门大学金融系教授、博导，厦门大学国家级金融重点学科金融工程学术带头人，厦门大学研究生院副院长，美国UCLA大学富布赖特访问研究学者，英国伦敦经济学院高级研究学者。曾先后任亚洲太平洋地区金融学会（APFA）中国理事、中国金融学年会第二届理事会主席、

## 书籍目录

第一章 金融工程概述 第一节 什么是金融工程 第二节 金融工程的发展历史与背景 第三节 金融工程的基本分析方法 本章小结 习题第二章 远期与期货概述 第一节 远期与远期市场 第二节 期货与期货市场 第三节 远期与期货的比较 本章小结 习题第三章 远期与期货定价 第一节 远期价格与期货价格 第二节 无收益资产远期合约的定价 第三节 支付已知现金收益资产远期合约的定价 第四节 支付已知收益率资产远期合约的定价 第五节 远期与期货价格的一般结论 第六节 远期(期货)价格与标的资产现货价格的关系 本章小结 习题第四章 远期与期货的运用 第一节 运用远期与期货进行套期保值 第二节 运用远期与期货进行套利与投机 本章小结 习题第五章 股指期货、外汇远期、利率远期与利率期货 第一节 股票指数期货 第二节 外汇远期 第三节 远期利率协议 第四节 利率期货 本章小结 习题第六章 互换概述 第一节 互换的定义与种类 第二节 互换市场 本章小结 习题第七章 互换的定价与风险分析 第一节 利率互换的定价 第二节 货币互换的定价 第三节 互换的风险 本章小结 习题第八章 互换的运用 第一节 运用互换进行套利 第二节 运用互换进行风险管理 第三节 运用互换创造新产品 本章小结 习题第九章 期权与期权市场 第一节 期权的定义与种类 第二节 期权市场 第三节 期权交易机制 第四节 期权与其他衍生产品的区别与联系 本章小结 习题第十章 期权的回报与价格分析 第一节 期权的回报与盈亏分布 第二节 期权价格的特性 本章小结 习题 附录 内在价值与平价点第十一章 布莱克—舒尔斯—默顿期权定价模型 第一节 布莱克—舒尔斯—默顿期权定价模型的基本思路 第二节 股票价格的变化过程 第三节 布莱克—舒尔斯—默顿期权定价公式 第四节 B—S—M期权定价公式的精确度评价与拓展 本章小结 习题 附录布莱克—舒尔斯—默顿期权定价公式的推导第十二章 期权定价的数值方法 第一节 二叉树期权定价模型 第二节 蒙特卡罗模拟 第三节 有限差分方法 本章小结 习题第十三章 期权的交易策略及其运用 第一节 期权交易头寸及其运用 第二节 期权交易策略及其运用 第三节 期权组合盈亏图的算法 本章小结 习题第十四章 期权价格的敏感性和期权的套期保值 第一节 Delta与期权的套期保值 第二节 Theta与套期保值 第三节 Gamma与套期保值 第四节 Vega、rho与套期保值 第五节 交易费用与套期保值 本章小结 习题第十五章 股票指数期权、外汇期权、期货期权与利率期权 第一节 欧式股票指数期权、外汇期权和期货期权的定价 第二节 标的资产支付连续红利的期权价格的敏感性 第三节 利率期权 本章小结 习题第十六章 奇异期权 第一节 常见的奇异期权 第二节 奇异期权的主要性质 本章小结 习题第十七章 风险管理 第一节 风险与风险管理概述 第二节 在险值 第三节 信用风险管理 本章小结 习题参考文献附表 标准正态分布累积概率函数表

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>