

<<金融工程>>

图书基本信息

书名：<<金融工程>>

13位ISBN编号：9787111299400

10位ISBN编号：711129940X

出版时间：2010.4.1

出版时间：机械工业出版社

作者：（美）博蒙特

页数：243

译者：叶永刚

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;

## 前言

每个人都可以走进金融工程的殿堂。

——译者的话 在由美国次贷危机引起的国际金融危机肆虐全球之际，我们翻译了博蒙特博士的这部《金融工程》。

一遍又一遍读完和翻译完书稿后，我们该在这部书的前面写篇译者序了。

写什么呢？

我们在思索。

难道作者仅仅是在告诉我们金融工程是什么吗？

不是的。

作者不仅仅在告诉我们金融工程是什么，而且还告诉我们，每一个人，只要你愿意，你就可以走进金融工程的殿堂。

作者通过本书告诉我们，金融工程与我们每个人的日常生活密不可分，因为它的运用涉及我们手中的货币，我们在银行的存款，我们在市场上买卖的股票和债券，我们在企业中的资本运作，我们在国家和国际层面的金融风险……作者通过精心的内容设计，向我们讲述金融工程的主要内容。

金融工程不仅是一种“工具论”，需要研究各种金融工具及其组合；也是一种“结构论”，需要进行结构上的优化；更是一种“风险论”，无论是工具层面，还是结构层面，都要在控制风险的前提下，有效地配置金融资源。

作者通过简明而形象的三角形表述方式向我们通俗透彻地讲述了金融工程的基本原理。

尽管谁都可以从本书中受益，但我们感到，本书似乎更多的是为那些并没有受过专门数学训练的读者而准备的。

在本书里很难找到一个深奥的数学公式，但它却完整地介绍了金融工程的基本原理，深刻地分析了金融创新的奥秘并系统地介绍了金融风险管理的技巧。

作者撰写本书时，全球金融危机还没有爆发，但是读完了本书，你一定可以理解金融危机为什么会爆发。

因为在危机中涉及的主要金融工具特别是衍生金融工具，在本书中已有详细的介绍和交代。

本书由两大部分构成，第一大部分介绍金融工程所运用的各种产品、现金流和信用，第二大部分主要探讨金融工程、风险管理和市场环境等内容。

全书包括6章内容：第1章，产品；第2章，现金流；第3章，信用；第4章，金融工程；第5章，风险管理；第6章，市场环境。

叶永刚负责全书的组织协调、技术指导及校阅工作，并翻译了文前、第1章、第2章和第3章；郑小娟翻译了第4章；马晓昱和吕思颖翻译了第5章；王勤翻译了第6章。

感谢机械工业出版社领导对我们的信任、支持和关照，感谢武汉大学经济与管理学院天星印务社付出的辛勤打印工作和制图工作。

感谢一切对本书翻译和出版工作提出合理建议和付出过各种劳动的人们。

## <<金融工程>>

### 内容概要

本书为金融工具的分析 and 定价提供了一个统一的理论框架，书中展示了如何运用独特的三角分析方法来分解和构建金融产品和工具。

全书分为两大部分，第一部分包括第1~3章，即产品、现金流和信用，这三章构成整体框架的基础。第二部分包括第4~6章，作者在这一部分阐述了如何更好地对金融工具进行定价，并构建有效的投资组合。

本书仔细考察了各种投资决策的意义，并且构建了一种框架来分析投资者和投资组合管理者如何评估各种市场机会。

## 作者简介

佩里 H.博蒙特 (Perry H.Beaumont)，博蒙特在高级财务岗位上任职近20年。他曾担任法国巴黎安盛投资管理公司 (AXA Investment Managers) 的战略与营销国际总裁和固定收益管理委员会委员，同时他还担任纽约所罗门美邦公司 (Salomon Smith Barney) 的执行董事，在该公司，他同时担任利率策略委员会主席，并且是固定收益管理委员会和资产配置委员会的成员。

## &lt;&lt;金融工程&gt;&gt;

## 书籍目录

赞誉 作者简介 译者序 序言 前言 致谢 导言 第一部分 产品、现金流和信用 第1章 产品 1.1 承诺与优先权 1.2 利率平价 1.3 购买力平价 1.4 本章小结 第2章 现金流 2.1 有关债券的即期定价 2.2 即期小结 2.3 期货 2.4 债券期货 2.5 现金结算的股权期货 2.6 使用货币期货的各种机会 2.7 关于远期和期货的小结 2.8 结束语 2.9 有关债券、股权和货币的小结 2.10 本章小结 附录2A 第3章 信用 3.1 信用风险难以捉摸的性质 3.2 质押和资本 3.3 信用衍生工具 3.4 本章小结 第二部分 金融工程、风险管理和市场环境 第4章 金融工程 4.1 债券产品中的期权性风险变化 4.2 绝对回报投资 4.3 相对回报投资 4.4 本章小结 附录4A 第5章 风险管理 5.1 债券价格风险：久期与凸性 5.2 股票价格风险： $\beta$  5.3 产品相关性 5.4 现金流相关性 5.5 本章小结 附录5A 第6章 市场环境 6.1 本章小结 6.2 结论

媒体关注与评论

《金融工程》这部书将各种精心制作的最优秀的“实践指南”与宝贵的“参考文献”整合在一起，以求使读者掌握金融工程的工具。

毫无疑问，这种工具在其投资管理的工具箱中将成为最为有用的工具之一。

——吉伯特 A. 本茨 ( Gilbert A. Berlz ) 瑞银集团，Investment Solutions 执行主席 简单地说吧，他又一次马到成功。

建立在他先前所做的固定收益市场写作的基础之上，博蒙特如愿以偿地运用实事求是的风格，将我们引入了一个关于债券、股权和货币市场相交叉的崭新视野。

《金融工程》已经在我书架上为教科书准备的地方，拥有了一个重要位置，而且还将长期盘踞，并且很少会让灰尘黏附其上。

——史蒂夫·奥里斯塔格里奥 ( Steve Oristaglio ) 帕特南投资公司高级主管及合伙人

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>