

<<金融工程学理论与实务>>

图书基本信息

书名：<<金融工程学理论与实务>>

13位ISBN编号：9787301212806

10位ISBN编号：7301212801

出版时间：2012-9

出版单位：北京大学出版社

作者：谭春枝 等主编

页数：355

字数：530000

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>

## <<金融工程学理论与实务>>

### 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：金融工程学理论与实务（第2版）》体系完整，《21世纪全国高等院校财经管理系列实用规划教材：金融工程学理论与实务（第2版）》分为3篇：基本理论篇、金融工具篇和技术运用篇。

基本理论篇包括金融工程导论、金融工程的基本分析方法、金融创新及金融风险管理；金融工具篇包括远期、期货、互换、期权、期权定价理论及实物期权；技术运用篇包括外汇风险的管理、利率风险的管理、股票风险的管理、信用风险的管理及投机和套利。

《21世纪全国高等院校财经管理系列实用规划教材：金融工程学理论与实务（第2版）》不仅注重基本理论的介绍，而且注重较复杂定价模型的理论推导，并且重视对这些理论模型所蕴含的基本思想和基本理念的阐述，用通俗平实的语言对复杂的理论和模型进行透彻的分析，对重要的问题进行深入浅出的阐述，以使学生能尽快地掌握理论和模型的实质。

此外，本书还提供了大量的图表，以使复杂的问题直观化和简明化。

本书适合作为高等院校金融学及相关专业高年级学生和研究生学习金融工程的教材，同时也适合作为金融和财务实际工作者了解金融工程的参考书籍。

## <<金融工程学理论与实务>>

### 书籍目录

#### 第1篇 基本理论篇

#### 第1章 金融工程导论

##### 1.1 金融工程概述

###### 1.1.1 金融工程的概念

###### 1.1.2 金融工程的产生与发展

###### 1.1.3 促进金融工程发展的因素

##### 1.2 金融工程的基本框架

###### 1.2.1 现代金融学的基本框架

###### 1.2.2 金融工程的基本框架概述

##### 1.3 金融工程的应用

###### 1.3.1 套期保值

###### 1.3.2 投机

###### 1.3.3 套利

###### 1.3.4 构造

##### 1.4 金融工程的发展现状及前景

###### 1.4.1 金融工程的发展现状

###### 1.4.2 金融工程的发展前景

#### 小结

#### 思考与练习

#### 第2章 金融工程的基本分析方法

##### 2.1 现代资本结构理论

###### 2.1.1 传统资本结构理论

###### 2.1.2 MM理论

##### 2.2 无套利均衡分析法

###### 2.2.1 预备知识：现金流及复制技术

###### 2.2.2 金融工程与无套利均衡分析

###### 2.2.3 无套利均衡分析的基本思想

###### 2.2.4 无套利均衡分析的应用

###### 2.2.5 状态价格定价技术

##### 2.3 积木分析法

###### 2.3.1 金融工程与积木分析法

###### 2.3.2 几种基本的金融积木

###### 2.3.3 金融积木的综合分析

#### 小结

#### 思考与练习

#### 第3章 金融创新

##### 3.1 金融创新概述

###### 3.1.1 金融创新的含义

###### 3.1.2 金融创新的类型

###### 3.1.3 金融创新的特征

##### 3.2 金融创新的背景和动因

###### 3.2.1 金融创新的背景

###### 3.2.2 金融创新的动因

##### 3.3 金融创新的影响

###### 3.3.1 金融创新对金融业发展的积极影响

## <<金融工程学理论与实务>>

3.3.2 金融创新对金融业发展的消极影响

3.4 金融产品的创新方法

3.4.1 时间扩展法

3.4.2 组合分解法

3.4.3 基本要素调整法

3.4.4 条款增加法

3.4.5 技术发展创新法

小结

思考与练习

第4章 金融风险管理

4.1 金融风险概述

4.1.1 金融风险的含义及特征

4.1.2 金融风险的分类

4.2 金融风险的识别与度量

4.2.1 金融风险的识别

4.2.2 金融风险的度量

4.3 金融风险管理的方法

4.3.1 分散风险——资产组合理论

4.3.2 转移风险——套期保值理论

小结

思考与练习

第2篇 金融工具篇

第5章 远期

5.1 远期概述

5.1.1 远期合约的含义

5.1.2 远期合约的要素

5.1.3 远期合约的种类

5.2 远期利率协议

5.2.1 预备知识：连续复利

5.2.2 远期利率的确定

5.2.3 远期利率协议的含义

5.2.4 远期利率协议的术语

5.2.5 远期利率协议的交割

5.3 远期外汇合约

5.3.1 远期汇率的确定

5.3.2 直接远期外汇合约

5.3.3 远期外汇综合协议

5.4 远期合约的定价

5.4.1 基本假设和符号

5.4.2 远期价格和远期价值

5.4.3 无收益资产远期合约的定价

5.4.4 支付已知现金收益资产远期合约的定价

5.4.5 支付已知收益率资产远期合约的定价

小结

思考与练习

第6章 期货

6.1 期货概述

## <<金融工程学理论与实务>>

- 6.1.1 期货合约的含义
- 6.1.2 期货合约的要素
- 6.1.3 期货合约的种类
- 6.1.4 期货合约与远期合约的比较
- 6.2 期货价格与现货及远期价格的关系
- 6.2.1 期货价格与现货价格的关系
- 6.2.2 期货价格与远期价格的关系
- 6.3 金融期货合约的定价
- 6.3.1 外汇期货的定价
- 6.3.2 股票指数期货的定价
- 6.3.3 短期利率期货的定价
- 6.3.4 长期利率期货的定价

小结

思考与练习

### 第7章 互换

#### 7.1 互换概述

- 7.1.1 互换的含义
- 7.1.2 互换合约的产生与发展
- 7.1.3 互换合约的要素
- 7.1.4 互换的种类
- 7.1.5 互换确认书

#### 7.2 互换的基本原理

- 7.2.1 比较优势理论
- 7.2.2 利率互换原理
- 7.2.3 货币互换原理
- 7.2.4 结论

#### 7.3 利率互换的定价

- 7.3.1 相关规定
- 7.3.2 利率互换在期初的定价
- 7.3.3 利率互换在期初之后的价值

#### 7.4 货币互换的定价

- 7.4.1 相关规定
- 7.4.2 货币互换在期初的定价
- 7.4.3 货币互换在期初之后的价值

小结

思考与练习

### 第8章 期权

#### 8.1 期权概述

- 8.1.1 期权合约的含义

.....

### 第3篇 技术运用篇

## &lt;&lt;金融工程学理论与实务&gt;&gt;

## 章节摘录

**金融工程导论** 本章主要介绍金融工程的基本概念、金融工程的发展过程和基本框架，以及金融工程的应用。

其中，金融工程的基本概念和基本框架是本章的重点；通过了解金融工程的应用并且理解金融工程功能是本章的难点。

**1.1金融工程概述** 金融（finance）是指资金的融通，工程（engineering）则是“应用科学知识使自然资源为人类服务的一种专门技术”，两者之间原本并不搭界，但是随着世界经济的发展、信息技术的进步以及学科之间的交叉渗透，工程的思想与理念逐步在金融领域得到应用，并逐渐发展成一门新的交叉学科——金融工程。

到20世纪90年代，金融工程技术、方法和手段被广泛运用于解决日益复杂的金融、财务问题，其对金融业和世界经济的发展产生了深远的影响。

**1.1.1金融工程的概念** “金融工程”一词由financial engineering翻译而来，是“金融”与“工程”的结合，早在20世纪50年代就曾出现在有关文献中，但是金融工程作为一门独立学科出现，则是20世纪90年代初的事情，最早提出金融工程学科概念的是美国金融学教授约翰·芬纳蒂（John Finnerty）。

1988年，约翰·芬纳蒂将金融工程定义为将工程思维引入金融领域，综合采用各种工程技术方法（主要有数学模型、数值计算、网络图解、仿真模型等）设计、开发和实施新型的金融产品，创造性地解决各种金融问题。

他认为金融工程学的研究范围主要包括3个方面：一是新型金融工具的设计与开发；二是为降低交易成本的新型金融手段的开发；三是为解决某些金融问题提供创造性的解决方案和方法。

1993年，美国罗彻斯特大学西蒙管理学院教授克里弗德·W·史密斯（Clifford W. Smith）和大通曼哈顿银行经理查尔斯·W·史密斯森（Charles W. Smithson）在他们合著的《金融工程手册》（The Handbook of Financial Engineering）中将金融工程定义为用基础的资本市场工具组合成新工具、创造出导致非标准现金流的金融合约的工程。

.....

## <<金融工程学理论与实务>>

### 编辑推荐

传承创新：秉承了第1版的编写特色，吸纳当前最新理论、最新教改成果以及使用院校的宝贵意见，并遵循最新发布各项准则、规范  
科学实用：注重专业知识和操作技能，并培养学生的实践能力  
案例教学：融入了最新的实例以及操作性较强的案例，并对实例进行有效的分析，着重培养学生的职业意识和职业能力  
人文融入：将人文知识融入理论讲解，提高学生人文素养  
学生为本：站在学生角度思考问题，考虑学生学习的动力，强调锻炼学生的思维能力以及运用知识解决问题的能力  
方便教学：网上提供完备的电子课件、习题参考答案等教学资源，适合教学需要

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>