第一图书网, tushu007.com

<<金融工程原理>>

图书基本信息

书名：<<金融工程原理>>

13位ISBN编号：9787302037149

10位ISBN编号：7302037140

出版时间：1999-10

出版时间：清华大学出版社

作者：宋逢明

页数：209

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

本书全面而系统地围绕现代金融学的基本方法论——无套利均衡分析讨论金融工程的原理。
全书共分十章。
第一章引入基本的无套利均衡分析方法；第二章讨论利率的期限结构，以建立起货币的时间价值概念；第三和第四章介绍基本的投资和资产定价理论；第五和第六章讨论动态无套利均

作者简介

宋逢明教授，是著名金融学家，中国金融学会副秘书长、常务理事、学术委员会委员、金融工程专业委员会主任委员，是国内金融工程学科的主要倡导者和学术代表，被传媒称为“我国金融工程的开拓者和引路人”（1998年7月13日《中国证券报》等。

<<金融工程原理>>

书籍目录

序言： 金融工程的方法论基础vii.第一章无套利均衡分析方法1. 企业价值的度量2. mm理论3. 加权平均资本成本4. mm理论的涵义5. 状态价格定价技术6. 市场的完全性7. 小结练习题第一章数学附录状态价格的涵义第二章利率的期限结构1. 利率的确定2. 金融风险和无风险证券3. 国库券的收益曲线4. 折现因子5. 远期利率6. 互换的定价7. 收益曲线的形状8. 小结练习题第三章两基金分离定理与资本资产定价模型1. 投资组合的选择2. 预期收益和风险的权衡3. 风险的分散化4. 两基金分离定理5. 资本市场线6. 市场组合7. 资本资产定价模型（capm）8. 小结练习题第三章数学附录1. 两基金分离定理的证明2. 证券市场线的推导第四章指数模型和套利定价理论1. 单指数模型2. 市场模型3. 多指数模型4. 套利概念的深化5. 单因素的套利定价理论（apt）6. 多因素的套利定价理论7. apt和capm的比较8. 小结练习题第四章数学附录套利定价理论用于单项资产定价的数学证明第五章期权定价与动态无套利均衡分析1. 期权简介2. 期权定价的基本无套利关系3. 买权和卖权的平价关系4. 动态无套利均衡分析5. 期权定价--二叉树方法6. 风险中性假设7. 利用风险中性假设的二叉树定价8. 小结练习题第六章布莱克?舒尔斯期权定价模型1. 股票价格运动的规律2. 布莱克?舒尔斯期权定价模型3. 风险中性定价4. 布莱克?舒尔斯期权定价公式的推广..5. 其他方面的推广6. 小结练习题第六章数学附录1. 伊藤引理的证明2. 关于伊藤过程的说明第七章等价鞅测度模型和无套利均衡基本定理1. 多阶段证券市场模型和自融资简单交易策略2. 价格体系和多阶段证券市场模型的生存性3. 等价鞅测度4. 无套利均衡基本定理5. 数字例子6. 小结练习题第八章或有要求权的估值1. 折现现金流估值： 债券和股票2. 或有要求权估值： 债券和股票3. 动态复制技术4. 公司的融资决策5. 认股权证6. 可赎回债券7. 可转换债券8. 可赎回的可转换债券9. 公司的投资决策10. 实物期权11. 实物期权与金融期权的比较12. 小结练习题第八章数学附录固定收入折现现金流的估值关系第九章市场环境、交易方式与资产定价1. 有效率市场假设2. 盯市与非盯市：期货与远期3. 相对优势的利用和金融中介的作用：互换4. 各种利率期权5. 利率的期限结构模型6. 小结练习题第十章风险管理概述1. 风险的分类2. 风险暴露和风险管理3. 风险转移方法4. 套期保值的基本原理5. 组合保险技术6. 久期与凸性7. 风险价值8. 信用矩阵9. 组合与分解-复合金融工具10. 小结练习题第十章数学附录1. 关于调整复制组合要花费的成本的说明2. 组合保险投资比例变化规律的数学证明3. 组合保险的有保障收益4. 久期可加性的证明参阅资料...

编辑推荐

《金融工程原理：无套利均衡分析》全面而系统地围绕现代金融学的基本方法论——无套利均衡分析讨论金融工程的原理。

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