第一图书网, tushu007.com

<<衍生产品概论>>

图书基本信息

书名：<<衍生产品概论>>

13位ISBN编号：9787810844277

10位ISBN编号：781084427X

出版时间：2005-2

出版时间：东北财经大学出版社

作者：罗伯特·A.斯特朗

页数：353

译者：王振山

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

《当代金融名著译丛：衍生产品概论》对期权、期货、互换以及利率期权市场进行了详细的介绍，讲述了衍生产品定价的基本原理。
作者将从投机者和套期保值者处观察到的大量的应用实例包括在本书当中，这对深入理解金融衍生产品实践有着巨大裨益。
同时设计了各种栏目，生动地说明如何运用衍生产品去达到投机、获利或风险管理的目的。
适用层次：本书是适用于金融学专业大学本科和研究生教育的极富价值的教材和参考书，对于希望了解金融衍生产品的相关知识的经济管理类相关专业学生和社会各界读者，本书也将提供非常有意义的帮助。

作者简介

罗伯特·A.斯特朗，缅因州大学投资教育部的基金会教授以及缅因州大学金融学教授。
他在美国西点军事学校获得了工程学学士学位，在波士顿大学获得了工商管理硕士学位，在佩恩州大学获得了金融学博士学位。
他同时也是缅因州海上高等学院以及哈佛大学的客座教授。
1997-1999年曾任哈佛大学夏季经济学项目的副主管。
他是持有特许注册证书的金融分析师。
斯特朗博士的咨询业务集中在风险管理和资产评估上。
向他咨询过的机构团体包括：东缅因州保健公司、班格尔水电公司、缅因州大众服务公司、大西洋能源公司、缅因州警察局、缅因州森林服务部、欧文石油以及国家广播公司。
他曾做过芝加哥期权交易所（CBOE）、芝加哥商品交易所（CBOT）以及美国证券交易所的协商会发言人。
现今，他的研究方向主要集中在投资者资产分配上。
从《金融期刊》与《证券组合管理期刊》到交易类期刊《投资与养老金》和《期货》都刊登过他的文章。
他在2000年出版发行了他的第三本书《投资管理实践》的第二版。
斯特朗博士是东北经贸协会刚卸任的主席，缅因州警察局荣誉上尉，波士顿证券分析师协会缅因州分会的董事会成员，白马有限公司董事会成员，班格储蓄银行和班格基金储蓄银行的董事会成员，东缅因州慈善集团的董事会成员，同时他还是里唯达证券公司的董事会主席。
王振山，1964年生，经济学博士，教授，博士生导师。
现任中国国际金融学会理事、东北财经大学金融学院院长、中国金融出版社金融学专业教材委员会委员、大连城市经济学会常务理事、辽宁省及东北财经大学学科带头人。
辽宁省优秀博士论文获得者、大连市优秀教师、霍英东基金会高校优秀青年教师获得者。
主要从事金融基础理论和资本市场理论研究。
1996年以来出版专著2部、教材5部、发表学术论文30余篇，承担国家及省部级科研项目5项。
代表作有《金融效率论》、《中国金融效率研究》、《银行规模与中国商业银行运行效率研究》等。

<<衍生产品概论>>

书籍目录

第1章 绪论1.1 序言1.2 衍生产品的种类1.3 衍生产品的参与者1.4 衍生产品的用途1.5 有效研究衍生产品附录1A第2章 股票期权的基本原理2.1 什么是期权，它们从何而来2.2 期权为何是一种好想法2.3 期权在哪里交易，如何交易2.4 期权费2.5 期权的收益与损失第3章 基本期权策略：有抵补的看涨期权和有担保的看跌期权3.1 利用期权套期保值3.2 用期权获得收入3.3 稳定的股票头寸的损益图3.4 转好市况第4章 期权组合与价差4.1 组合期权4.2 价差4.3 非标准价差4.4 其他策略4.5 保证金要求4.6 评价价差第5章 期权的定价5.1 期权定价的简要历史5.2 套利与期权定价5.3 直观布莱克－斯科尔斯模型附录5A第6章 布莱克－斯科尔斯期权定价模型6.1 布莱克－斯科尔斯期权定价模型6.2 用历史数据计算布莱克－斯科尔斯价格6.3 隐含波动率6.4 用布莱克－斯科尔斯模型解看跌期权期权费第7章 期权的希腊字母7.1 主要的期权定价衍生产品7.2 其他衍生产品7.3 德尔塔中性7.4 两个市场：走向与震荡7.5 动态套期保值第8章 期货市场的基本原理8.1 期货合约的概念8.2 市场的技术性细节8.3 市场参与者8.4 清算过程8.5 期货合约定价的基本原理8.6 商品期货价差第9章 股票指数期货9.1 股票指数及其期货合约9.2 股票指数期货的用途9.3 用股票指数期货套期保值第10章 外汇期货10.1 外汇风险10.2 远期汇率10.3 外汇期货10.4 风险的处理第11章 利率期货的基本原理11.1 利率期货11.2 短期国债、欧洲美元及其期货合约11.3 用短期国债期货套期保值11.4 长期国债及其期货合约11.5 利率期货合约的定价11.6 用利率期货获得价差第12章 期货合约与投资组合管理12.1 风险免疫的概念12.2 用期货改变资产配置第13章 互换和利率期权13.1 利率互换13.2 外币互换13.3 交叉互换13.4 利率期权第14章 互换定价14.1 直观互换定价14.2 确定互换价格14.3 离市互换定价14.4 互换的套期保值14.5 货币互换定价第15章 其他衍生资产第16章 金融工程和风险管理第17章 当代问题研究术语表自测题答案

第一图书网, tushu007.com

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