

<<金融衍生工具>>

图书基本信息

书名：<<金融衍生工具>>

13位ISBN编号：9787810980319

10位ISBN编号：7810980319

出版时间：2004年01月

出版时间：上海财经大学出版社

作者：陈信华

页数：548

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;金融衍生工具&gt;&gt;

## 内容概要

20世纪70年代，以金融制度创新和金融工具创新为主要内容的金融创新（financial innovation）浪潮在西方发达国家此起彼伏，风起云涌。

特别是各种新颖的金融衍生工具层出不穷，交易量在世界范围内迅速扩大，其对宏观金融运行的影响及在微观财务管理中的作用日益显现。

在各种金融衍生工具中，期权是最富创造性的一种，它从根本上改变了以往所有交易方式的盈亏对称性特征，从而使市场交易经历了一场深刻的革命。

期权合约的推出极大地丰富了投资策略的选择范围，因为期权交易除了它本身能进行各种组合之外，还能与其他交易工具一起使用，从而能适应各种各样的市场行情变化和投资者的预期心理。

除了在金融投资领域中被用于市场风险的控制与市场盈利机会的发掘之外，期权思想在矿产资源的开发、研发费用（R&D）的投入、实物资产的购买、工程的评估、项目的筹建等资本预算或决策分析过程中也被积极引入。

换言之，除了金融期权之外，实物期权（real options）、管理期权（managerial options）在“不确定条件下的投资”领域中也正在大显身手。

如今，作为一种选择权，期权无处不在。

可以毫不夸张地说，期权合约及其所体现的交易思想是20世纪金融领域中最重要创新，它带来了投资决策方法的革命，是改善战略思维的最有价值的工具。

## 作者简介

陈信华，男，1954年生于上海，祖籍浙江余姚。  
1982年毕业于上海师范学院中文系，获文学学士学位。  
1988年毕业于复旦大学世界经济系，获经济学硕士学位。  
2000年毕业于上海社会科学院世界经济研究所，获经济学博士学位。

自80年代中期起进入高等院校从教，一直担任“国际金融”、“国际融资”、“货币银行学”、“外汇银行业务”、“金融工程”及“跨国公司财务管理”等课程的教学工作，现为上海大学国际工商与管理学院金融系主任、教授。

个人专著有《外汇经济学》、《财务报表分析技巧》、《开放经济国际收支的宏观调节论》、《国际金融管理》、《证券投资讲义》，其中《外汇经济学》由台湾五南图书出版公司以繁体字版本在中国台湾地区重印发行。

与人合著有《跨国公司教程》、《国际经济学教程》。

此外，还参加过张幼文主编的《世界经济学》、周振华主编的《金融改造》及伍贻康和张幼文主编的《全球村落：一体化进程中的世界经济》等书的编写工作；独立主持过“人民币自由兑换与外汇风险管理”和“开放经济条件下的宏观调控和政策协调”等市级研究课题，并在国内刊物上发表过数十篇有关世界经济、国际金融及财务管理的论文。

## 书籍目录

总序内容简介绪论第一章 资产定价的基础知识及债券、股票的定价模型第一节 单笔资金、普通年金、即付年金的终值与现值第二节 永续年金的现值及增长型永续年金的现值第三节 债券与股票的定价复习思考题第二章 远期价格及远期合约的定价原理第一节 现货（即期）交易与远期交易第二节 远期价格的确定第三节 远期合约的价值第四节 无风险资产和无风险利率复习思考题第三章 金融期货的交易规则及其定价原理第一节 期货市场的形成与发展第二节 金融期货的交易规则第三节 金融期货定价的持仓成本模型第四节 期货合约的价值<sup>96</sup>第五节 期货价格与预期中的未来现货价格复习思考题第四章 外币期货、利率期货及股指期货第一节 外币期货交易第二节 短期利率期货交易第三节 长期利率期货交易第四节 股指期货交易复习思考题第五章 期权市场的运作机制第一节 期权市场的形成与发展第二节 期权交易的分类及交易的盈亏特征第三节 期权合约的标准化特征第四节 期权合约的场外交易与期货合约的期权交易复习思考题第六章 期权交易的行情解读与投资策略第一节 期权行情的解读第二节 期权交易的创新意义及其投资策略第三节 抵补头寸第四节 价差头寸第五节 组合头寸第七章 期权定价过程中的无风险套利限制第一节 无股息支付的股票期权的价格上下限第二节 预期有股息支付的股票期权的价格上下限第三节 美式期权的提前执行问题第四节 期权定价的其他限制复习思考题第八章 期权定价的二项式模型第一节 二项式期权定价模型的推导：单期模型第二节 两期二项式期权定价模型第三节 期权定价n期模型的通用公式.....第九章 布莱克-斯科尔斯的期权定价模型第十章 布莱克-斯科尔斯模型的修正与扩展第十二章 期权定价模型的静态分析第十二章 多期期权、奇异期权及期权思想的其他运用第十三章 其他金融衍生工具的定价与运用参考文献后记附表

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>