

<<期权与期货市场基本原理>>

图书基本信息

书名：<<期权与期货市场基本原理>>

13位ISBN编号：9787111346166

10位ISBN编号：7111346165

出版时间：2011-6

出版时间：机械工业

作者：约翰 C.赫尔

页数：439

译者：王勇

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>

<<期权与期货市场基本原理>>

内容概要

本书是约翰·赫尔教授专门为那些没有受过金融数学系统训练的高校学生和从业人员而写的，其内容囊括了《期权、期货及其他衍生产品》一书的基础理论，提供了大量业界实例。而且没有涉及到微积分应用。

相较旧版，第7版新增了两章全新的内容：一是介绍了次级贷款派生出来的产品，讨论其问题所在，并展望将来如何防范危机；二是特别讲述了雇员股票期权，强调由于会计准则的变化使得学生应该更加重视对雇员股票期权的理解以及定价。

另外，作者还为该书配套了包含信用衍生产品的DerivaGem软件，它可以定价多种期权，也可以检测期权的性质并可以较为容易地将这些程序用于数值计算。

本书适用于金融、财务或相关专业的本科生，以及MBA或其他非经济类研究生。

另外，从业人员可以选用这本书来提高自身对于期货及期权的了解。

<<期权与期货市场基本原理>>

作者简介

约翰·赫尔：衍生产品和风险管理教授，在衍生产品和风险管理领域享有盛名，研究领域包括信用风险、经理股票期权，波动率曲面市场风险以及利率衍生产品。

他和艾伦·怀特(Alan White)教授研发出的赫尔·怀特(Hull-White)利率模型荣获Nikko-LOR大奖。

他曾为北美、日本和欧洲多家金融机构提供金融咨询。

约翰·赫尔教授著有《风险管理与金融机构》《期权、期货和其他衍生产品》和《期权与期货市场基本原理》等金融专著。

这些著作被翻译成多种语言，并在世界不同地区的交易大厅中广泛采用。

王勇：西安交大理科学士，加拿大达尔豪斯大学博士，持有CFA和FRM证书。

现任加拿大皇家银行全球风险管理部董事总经理，主管全行的模型定量分析。

他在衍生产品交易、金融工程等领域有很深的造诣，著有风险管理专著。

王勇博士曾给中国国家外汇管理局、中国工商银行等十几家金融机构的高级管理人员提供风险管理培训，并受邀在加拿大三家著名高校研究生院讲课。

王勇博士是加中金融协会的创始人之一。

袁俊博士现任加拿大皇家银行全球市场风险定量分析部经理，主要负责股票相关产品(包括股指期货、期权和其他衍生品)的定量分析，业务涉及产品模型定价、对冲策略以及风险管理。

袁俊博士2001年毕业于中国上海交通大学本科，2003年获加拿大女皇大学硕士学位，2007年获加拿大多伦多大学博士学位；他现在是注册风险管理师(FRM)。

<<期权与期货市场基本原理>>

书籍目录

推荐序一(常振明)

推荐序二(彭实戈)

译者序

前言

作者简介

译者简介

第1章 引言

1.1 期货合约

1.2 期货市场的历史

1.3 场外交易市场

1.4 远期合约

1.5 期权合约

1.6 期权市场的历史

1.7 交易员的种类

1.8 对冲者

1.9 投机者

1.10 套利者

1.11 危害

小结

推荐阅读

测验题

练习题

作业题

第2章 期货市场的运作机制

2.1 期货合约的开仓与平仓

2.2 期货合约的规定

2.3 期货价格收敛到现货价格的特性

2.4 保证金的运作

2.5 场外市场

2.6 报纸上的报价

2.7 交割

2.8 交易员类型及交易指令类型

2.9 监管

2.10 会计及税收

2.11 远期与期货合约比较

小结

推荐阅读

测验题

练习题

作业题

第3章 采用期货的对冲策略

3.1 基本原理

3.2 拥护及反对对冲的观点

3.3 基差风险

3.4 交叉对冲

<<期权与期货市场基本原理>>

3.5 股指期货

3.6 向前滚动对

小结

推荐阅读

测验题

练习题

作业题

附录3A 统计的重要概念与资本资产
定价模型

第4章 利率

4.1 利率的类型

4.2 利率的测定

.....

第5章 远期及期货价格的确定

第6章 利率期货

第7章 互换

第8章 证券化与2007年信用危机

第9章 期权市场的动作过程

第10章 股标期权的性质

第11章 期权交易策略

第12章 二叉树简介

第13章 期权定价, 布莱克-期科尔斯-莫顿模型

第14章 雇员股票期权

第15章 股指期货和货币期权

第16章 期货期权

第17章 希腊值

.....

<<期权与期货市场基本原理>>

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>