

<<期权与期货市场基本原理>>

图书基本信息

<<期权与期货市场基本原理>>

内容概要

约翰·赫尔所著的《期权与期货市场基本原理(英文版第7版)》对金融衍生产品市场中的期权和期货的基本理论进行了深入系统的阐述,提供了大量的业界实例。

本书主要论述了期货市场的运作机制、采用期货的对冲策略、远期及期货价格的确定、期权市场的运作过程、股票期权的性质、期权交易策略、布莱克-斯科尔斯-默顿模型、希腊值及其应用、波动率微笑、风险价值度、特种期权及其他非标准产品、信用衍生产品、气候和能源以及保险衍生产品等。

同时,第7版还增加了证券化、始于2007年的金融危机及雇员股票期权的应用等新内容。

本书巧妙地避免了复杂的微积分计算,又不失理论的严谨性,给没有受过金融数学训练的许多金融从业人员提供了很好的指导。

《期权与期货市场基本原理(英文版第7版)》适用于高等院校经济、金融相关专业教学用书,也可以作为金融机构管理者,特别是衍生产品从业人员的参考用书。

<<期权与期货市场基本原理>>

作者简介

作者:(加)约翰·赫尔(John C.Hull), 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、期货及其他衍生产品》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。

赫尔曾荣获多项大奖, 其中包括多伦多大学著名的Northrop Frye教师大奖, 在1999年他被国际金融工程协会(International Association of Financial Engineers)评为年度金融工程大师(Financial Engineer of the Year)。

约翰·赫尔教授现任职于多伦多大学罗特曼管理学院, 曾任教于加拿大约克大学、美国纽约大学、英国克兰菲尔德大学、英国伦敦商学院等。

他现为8个学术杂志的编委。

<<期权与期货市场基本原理>>

书籍目录

总序 作者简介 前言 术语表 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 第3章 采用期货的对冲策略 第4章 利率 第5章 远期与期货价格的确定 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 期权市场的运作过程 第10章 股票期权的性质 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-斯科尔斯-默顿模型 第14章 发展中国家的衍生品市场 第15章 股指期权和货币期权 第16章 期货期权 第17章 希腊值 第18章 实际应用的二叉树 第19章 波动率微笑 第20章 风险价值表 第21章 利率期权 第22章 特种期权和其他非标准产品 第23章 信用衍生产品 第24章 气候、能源以及保险衍生产品 第25章 重大金融损失事件测试题答案附录

<<期权与期货市场基本原理>>

编辑推荐

《期权与期货市场基本原理(英文版第7版)》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，而且没有涉及微积分应用。

相较旧版，第7版新增了两部分全新的内容。

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>>

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>