

<<金融工程>>

图书基本信息

书名：<<金融工程>>

13位ISBN编号：9787300170237

10位ISBN编号：7300170234

出版时间：2013-3

出版时间：中国人民大学出版社

作者：林清泉

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;金融工程&gt;&gt;

## 内容概要

林清泉主编的《金融工程(第3版经济管理类课程教材)》较为全面地介绍了金融工程的理论及应用知识,结构清晰、语言浅显。

本书包括四篇内容:金融工程概述篇、金融工程理论篇、金融衍生产品篇和金融工程技术与管理篇。金融工程概述篇主要介绍了金融工程的定义和分析方法、金融工程的产生和发展以及主要金融衍生产品的基础知识。

金融工程理论篇主要包括资产组合理论、资产定价模型、有效市场理论、无套利分析方法和MM定理、期权及二叉树模型、布莱克-斯科尔斯期权定价理论。

金融衍生产品篇以金融衍生产品不同的标的资产为分类标准,并由此分别介绍了以货币为基础的衍生产品、以利率为基础的衍生产品、以权益为基础的衍生产品。

金融工程技术与管理篇主要包括汇率风险管理、股票风险管理、利率风险管理、信用风险管理和风险价值测算以及期权思想在公司财务中的应用,主要介绍可转换债券、股票期权以及实物期权。

## &lt;&lt;金融工程&gt;&gt;

## 书籍目录

第一篇 金融工程概述篇 第一章 金融工程概述 第一节 金融工程的界定 第二节 金融工程的分析方法 第三节 金融工程和金融创新 第二章 金融工程的产生和发展 第一节 从金融学到金融工程学 第二节 金融工程发展的因素 第三节 金融工程面临的挑战与发展趋势 第四节 金融工程在中国的发展 第三章 金融风险管理及金融衍生产品 第一节 金融工程和金融风险管理 第二节 金融风险管理的新工具——金融衍生工具 第二篇 金融工程理论篇 第四章 资产组合理论 第一节 传统的资产组合管理和现代资产组合理论 第二节 马科维茨的资产组合理论 第五章 资本资产定价理论 第一节 资本资产定价模型 第二节 套利定价模型 第六章 有效市场理论 第一节 有效市场假设概述 第二节 有效市场假设下的投资管理 第三节 有效市场假设的实证检验 第四节 研究市场有效性的重要方法——事件研究 第五节 我国股市有效性的游程检验 第七章 无套利分析方法 第一节 mm定理 第二节 状态价格定价方法 第三节 对可赎回债券价格的简单分析 第八章 期权的损益及二叉树模型 第一节 期权及其组合的损益 第二节 期权定价的二叉树模型 第三节 以债券为标的资产的期权定价二叉树模型 第四节 n期欧式期权的定价模型 第九章 期权定价公式及其应用 第一节 布莱克-斯科尔斯期权定价公式 第二节 期权价值的敏感性因素分析 第三节 期权套期保值的基本原理 第四节 连续调整的期权套期策略 第五节 组合套期策略 第三篇 金融衍生产品篇 第十章 以货币为基础的衍生工具 第一节 远期外汇交易 第二节 货币互换 第三节 外汇期货 第四节 外汇期权 第十一章 以利率为基础的衍生工具 第一节 远期利率协议 第二节 利率期货 第三节 利率期权 第四节 利率互换 第十二章 以权益为基础的衍生工具 第一节 股票期权 第二节 股指期货 第三节 股指期货 第四篇 金融工程技术与应用篇 第十三章 汇率风险管理 第一节 汇率风险概述 第二节 远期外汇合约与汇率风险管理 第三节 货币互换与汇率风险管理 第四节 外汇期货与汇率风险管理 第五节 外汇期权与汇率风险管理 第十四章 利率风险管理 第一节 利率风险概述 第二节 远期利率协议与利率风险管理 第三节 利率期货与利率风险管理 第四节 利率期权与利率风险管理 第五节 利率互换与利率风险管理 第十五章 股票价格风险管理 第一节 股票价格风险概述 第二节 股票指数期货与股票价格风险管理 第三节 利用股票期权管理股票价格风险 第四节 运用股票指数期权管理股票风险 第十六章 信用风险管理 第一节 信用风险概述 第二节 信用风险计量模型 第三节 管理信用风险的衍生产品 第四节 信用风险管理热点案例分析 参考文献

## 编辑推荐

林清泉主编的《金融工程(第3版经济管理类课程教材)》较为全面地介绍了金融工程的理论及应用知识,结构清晰、语言浅显。

本书包括四篇内容:金融工程概述篇、金融工程理论篇、金融衍生产品篇和金融工程技术与管理篇。金融工程概述篇主要介绍了金融工程的定义和分析方法、金融工程的产生和发展以及主要金融衍生产品的基础知识。

金融工程理论篇主要包括资产组合理论、资产定价模型、有效市场理论、无套利分析方法和MM定理、期权及二叉树模型、布莱克-斯科尔斯期权定价理论。

金融衍生产品篇以金融衍生产品不同的标的资产为分类标准,并由此分别介绍了以货币为基础的衍生产品、以利率为基础的衍生产品、以权益为基础的衍生产品。

金融工程技术与管理篇主要包括汇率风险管理、股票风险管理、利率风险管理、信用风险管理和风险价值测算以及期权思想在公司财务中的应用,主要介绍可转换债券、股票期权以及实物期权。

#### 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>