

图书基本信息

书名：<<期权、期货和其他衍生品（第5版）>>

13位ISBN编号：9787302124719

10位ISBN编号：730212471X

出版时间：2006-3-1

出版时间：清华大学出版社

作者：（加）约翰.赫尔（John C. Hull）

页数：682

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>

前言

世纪之交，中国与世界的发展呈现最显著的两大趋势——以网络为代表的信息技术的突飞猛进，以及经济全球化的激烈挑战。

无论是无远弗界的因特网，还是日益密切的政治、经济、文化等方面的国际合作，都标示着21世纪的中国是一个更加开放的中国，也面临着一个更加开放的世界。

教育，特别是管理教育总是扮演着学习与合作的先行者的角色。

改革开放以来，尤其是20世纪90年代之后，为了探寻中国国情与国际上一切优秀的管理教育思想、方法和手段的完美结合，为了更好地培养高层次的“面向国际市场竞争、具备国际经营头脑”的管理者

。

## 内容概要

《期权、期货和其他衍生品(第5版)》是一本在西方金融界广泛流传的名著，被誉为“华尔街的圣经”。

衍生品理论在现代金融学中占有核心的地位。

衍生品理论（尤其是期权定价理论）的提出，不但建立起金融经济学的基本理论框架，而且在理论的指导下推动了期货、期权、掉期等市场的发展，使金融在全球范围内发展到今天如此巨大的规模。

《期权、期货和其他衍生品(第5版)》全面而系统地讲解了衍生品定价与金融风险管理的基本理论和方法，在这一新版中又增加了4章新内容，涵盖了新的衍生工具和研究前沿。

通过阅读本书，可以系统掌握现代金融学的核心理论和基本方法，尤其是对有志于学习金融工程和投身于资本市场业务的读者来说，阅读本书是非常有价值的。

《期权、期货和其他衍生品(第5版)》可作为大专院校金融学及相关专业的本科生和研究生的教学用书，也可供金融业界人士用作业务手册以备查阅。

## 作者简介

约翰·赫尔（John Hull），加拿大多伦多大学罗特曼管理学院（Joseph L. Rotman School of Management）教授，Bonharm金融中心主任。

他是国际公认的衍生品权威，并在领域有多部著作。

Hull教授与Alan White因为在Hull-White利率模型上的工作赢得Nikko-LOR研究竞赛。

他是八家学术杂志的联合编辑，曾任北美、日本和欧洲多家金融机构的顾问。

Hull教授所著的两本书《期权、期货和其衍生品》与《期货与期权市场基本原理》被翻译成多种文字，并在全世界广泛流行。

他曾获得多个教学奖，包括多伦多大学享有盛誉的诺斯洛普弗莱奖（Northrop Erye award），并于1999年被国际金融工程师协会评选为年度金融工程师。

除多伦多大学外，Hull博士还曾在约克大学、不列颠哥伦比亚大学、纽约大学、格菲尔德大学、伦敦商学院任教。

书籍目录

序言第1章 绪论第2章 期货市场的机制第3章 远期和期货价格的确定第4章 期货的套期保值策略第5章 利率市场第6章 互换第7章 期权市场的机制第8章 股票期权的性质第9章 期权的交易策略第10章 二叉树模型介绍第11章 股票价格的行为模式第12章 Black-Scholes模型第13章 股票指数期权、货币期权和期货期权第14章 希腊字母第15章 波动率微笑第16章 风险值第17章 估计波动率与相关性第18章 数值方法第19章 奇异期权第21章 鞅和测度第22章 利率衍生品：标准的市场模型第23章 利率衍生品：瞬时利率模型第24章 利率衍生品：更高级的模型第26章 信用风险第27章 信用衍生品第28章 实物期权第30章 衍生品灾难以及我们能从中学到什么符号表术语表x<sub>0</sub>时N(x)表x<sub>0</sub>时N(x)表主题索引

编辑推荐

- 1.有关期货在套期保值中的应用的新章节 (第4章)。其中的部分内容原来分布在第2章和第3章。这一变化使得前3章的内容强度减弱,并使套期保值方面的内容更具深度。
- 2.有关模型和数值方法的新章节 (第20章)。这一章的内容大部分都是新的,但也有一些是从第4版奇异期权一章转过来的。
- 3.有额外章节讲授信用风险。第26章讨论信用风险与信用风险值 (value at risk) 的度量,而第27章讨论信用衍生品。
- 4.有关实物期权的新章节。
- 5.有新的一章讨论“衍生品灾难以及我们能从中学到什么” (第30章)。
- 6.有关鞅和测度的内容得以完善 (第21章)。
- 7.有关风险值的内容被重新编写,平衡了历史模拟法(historical simulation approach)和模式法 (model building approach)。
- 8.修订了波动率微笑 (volatility smiles) 的内容,并列于书中较靠前的地方。
- 9.扩充了LIBOR市场模型的内容 (第24章)。
- 10.符号有一两处变化。最显著的是执行价格 (strike price) 表示为K,而不是X。
- 11.章后加入很多新练习题。

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>