

<<金融工程前沿>>

图书基本信息

书名：<<金融工程前沿>>

13位ISBN编号：9787563817863

10位ISBN编号：7563817867

出版时间：2010-11

出版时间：首都经济贸易大学出版社

作者：田新民

页数：239

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>

## <<金融工程前沿>>

### 内容概要

金融工程是一门具有交叉性的新兴学科，它的产生来源于人们想通过金融市场防范金融风险的需要。综合各种观点，我们认为，金融工程将工程思维引入金融领域，融现代金融理论、数据处理技术、信息技术、工程技术于一体，采用尖端的数理分析和统计方法以及IT与网络技术、优化技术、仿真技术等前沿技术，对金融问题给予创造性的解决，包括创新型金融工具与金融手段的设计、开发与实施。随着我国金融市场的发展，金融工程方法及应用的研究也迅猛开展起来。

## 作者简介

田新民，男，1967年出生，博士，教授，博士生导师。

现任首都经济贸易大学经济学院副院长、数量经济研究中心副主任。

1984年毕业于北京大学数学系，获应用数学学士学位；1993年毕业于北京大学数学系，获应用数学硕士学位；1996年毕业于中国科学院系统科学研究所，获系统工程博士学位。

## 书籍目录

- 1 随机规划与资产负债管理技术 1.1 随机规划理论 1.2 传统银行资产负债管理 1.3 KUSY-ZIEMBA银行资产负债管理随机规划模型 1.4 我国商业银行资产负债管理随机规划模型 1.5 情景元素的生成 1.6 实证研究 参考文献2 投资组合理论及应用 2.1 规划理论 2.2 马科维茨的投资组合理论 2.3 资本资产定价模型 2.4 CVaR投资组合模型 参考文献3 布莱克 - 李特曼模型 3.1 基本模型 3.2 布莱克 - 李特曼模型的扩展 3.3 模型仿真 参考文献 附录4 金融中的网络优化 4.1 简介 4.2 金融最优化问题 4.3 一般金融均衡问题 4.4 存在中介的金融网络动力学 4.5 数值化实例 4.6 金融网络整合的社会网络 参考文献5 利率模型及利息率产品 5.1 利率期限结构的分类 5.2 利率模型的估计 5.3 市场模型：LIBOR方法 5.4 固定收益证券投资组合管理 5.5 远期利率协议及其风险管理 5.6 利率互换及其风险管理 5.7 利率期货及其风险管理 5.8 利率期权及其风险管理 参考文献6 股票指数期货交易与风险管理 6.1 股票价格指数 6.2 股指期货的特点与功能 6.3 股指期货的产生与发展 6.4 股指期货合约的设计与国际上具有代表性的股票指数期货合约 6.5 影响股指期货价格的因素及股指期货价格与股票现货价格的关系 6.6 股指期货交易 6.7 股指期货的风险类型 6.8 股指期货交易的风险管理 6.9 股指期货风险案例与分析参考文献

## 章节摘录

是在20世纪30年代的经济大危机之后，采取总库法是基于这样一个客观事实，活期存款是银行资金的最大来源，这种负债是独立于银行决策之外的外生变量，是由市场因素决定的，具有单一性，银行业在经历30年代资金周转困难的危机之后，更加强调资产运用的安全性，根据资产管理理论，银行开始运用资金总库法进行管理，其主要内容是，银行将来自于各种渠道的资金汇集起来，形成一个资金总库或称资金池，资金总库中的资金被无差别地视为同质的单一来源，然后再将总库中的资金分配到各种不同的资产上去，按照资金总库法，银行首先要参照银行同业公布的财务比率及自身的经验与判断，制定各资产流动性需求的标准，然后根据上述标准分配资金、确定资金分配的先后顺序。

(1) 保证充分的一级储备，一级储备主要包括库存现金、在央行的存款、同业存款及托收中的现金项目，一级储备主要用来满足具有强制性的准备金的需要，如法定准备金及日常营业中付款及支票清算所必须保有的现金，因此，一级储备处于高度优先的地位，但一级储备的赢利性很差，因此，银行总是将为应付突发性提款及贷款需要的第一道防线——超额准备金压缩到最小限度内。

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>