

<<中级金融工程学>>

图书基本信息

书名：<<中级金融工程学>>

13位ISBN编号：9787810983471

10位ISBN编号：7810983474

出版时间：2005-5-1

出版时间：上海财大出版社

作者：周洛华

页数：326

字数：446000

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>

<<中级金融工程学>>

内容概要

最近5年以来，金融学似乎已经被推进到了可知世界的边缘了，我们所有的努力，帮助我们开发出各种崭新的金融手段，将各种资产的空间头寸对冲之后，剩下的似乎是我们永远无法对冲的时间，正是这个时间概念锁住了金融学的全部未知世界。

令人沮丧的是，这个时间概念却并不是按照我们的腕表或者交易所的钟声所遵循的规律来运转的，这个时间概念导致传统金融的失效：巴林银行的倒闭、长期资本管理公司的破产、中国航空燃料油公司的投机失败、金融市场出现惊人的波动率的微笑等等现象，都是读者案头任何一本传统的金融学教科书从未涉及也无法解释的。

本书就是在这个背景之下撰写的，书中记载的是作者试图解开这些问题的最新探索和努力。

<<中级金融工程学>>

书籍目录

序言第一章 金融工程学导论 第一节 传统金融学的主要研究内容 第二节 金融工程学的发展 第三节 金融工程学的基本框架 第四节 金融工程学的应用范畴第二章 金融市场 第一节 金融市场决策资产价格 第二节 有效金融市场的假设 第三节 M&M定理及其意义 第四节 有价证券组合理论 附录 多元化投资降低风险的数学原理第三章 资产定价 第一节 资本资产定价模型 第二节 套利定价模式 第三节 资产定价的应用 第四节 资产定价模型的局限性 附录 回归分析在金融学中的几个应用第四章 金融工具 第一节 金融工具概述 第二节 金融工具的头寸 第三节 金融工具的头寸组合和头寸分解 第四节 选择金融工具 附录 对冲基金的交易策略之一：头寸的相关性第五章 债券 第一节 债券概述 第二节 债券的期限结构 第三节 债券的风险管理 第四节 推广与应用 附录 债券管理的数学方法第六章 期权 第一节 期权概述 第二节 期权定价法 第三节 期权投资法 第四节 公司债的定价 附录 时间序列分析：资产价格是一个随机过程第七章 期货和远期 第一节 期货和远期概述 第二节 期货和远期的定价 第三节 期货和远期的交易 第四节 互换交易 附录 创新互换还是空头买权第八章 实物期权第九章 价值投资第十章 价值管理附录一：金融学的相对论附录二：词汇表参考文献

<<中级金融工程学>>

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>