

<<金融工程>>

图书基本信息

书名：<<金融工程>>

13位ISBN编号：9787030193964

10位ISBN编号：7030193962

出版时间：2010-8

出版时间：科学出版社

作者：徐成贤，薛宏刚 著

页数：402

字数：493000

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>

## 内容概要

本书对金融工程中常用的计算方法和技术作了比较系统的介绍。全书分为四个部分，第一部分由前两章组成，主要介绍金融计算的基本方法，如现金流的时间价值和收益率的计算以及利率的期限结构等；第二部分包括第3-8章，主要介绍金融资产定价的计算方法，包括基础资产如债券、股票以及衍生产品如期货、互换、期权和信用衍生产品定价的计算方法；第三部分包括第9-11章，主要介绍金融风险度量的各种计算方法，如灵敏度法、波动性方法以及以风险的近代度量--风险价值（VaR）为主要框架的风险计算方法，详细介绍了VaR的三种常用的计算方法：参数法、历史模拟法和随机模拟法，这一部分还包括对信用风险估计和计算的方法；第四部分主要介绍用于风险控制和管理的方法，包括第12-14章，根据金融市场风险和信用风险的不同，分别讨论相应的用于风险控制和管理的方法。

本书可作为金融学、金融工程、数学与应用数学、信息和科学计算、管理工程等各专业本科高年级学生的教学用书，也可以作为相关专业研究生、MBA学员进行科学研究的参考书，或作为金融工程从业人员应用的工具书。

## 书籍目录

第1章 现金流的时间价值 § 1.1 现金流现值的计算 § 1.2 现金流将来值的计算 § 1.3 净现值的计算  
 § 1.4 收益率的计算 § 1.5 内部收益率的计算第2章 利率的期限结构 § 2.1 固定收益证券 § 2.2 到期收益率和即期利率 § 2.3 利率的期限结构和即期利率曲线 § 2.4 远期利率第3章 固定收益证券的定价方法 § 3.1 短期国库券的定价 § 3.2 用到期收益率为债券定价 § 3.3 用即期利率为债券定价  
 § 3.4 用远期利率预测债券价格 § 3.5 债券的久期 § 3.6 债券的凸度第4章 股票的定价 § 4.1 股票及其基本概念 § 4.2 Gordon红利定价模型 § 4.3 资本资产定价模型 (CAPM) § 4.4 证券市场线  
 § 4.5 股票指数的计算第5章 期货定价 § 5.1 远期合约的定价 § 5.2 期货简介 § 5.3 期货合约的定价方法 § 5.4 短期利率期货的定价 § 5.5 债券期货的定价 § 5.6 股票指数期货的定价第6章 互换的定价 § 6.1 互换的基本概念 § 6.2 利率互换的估值与定价方法 § 6.3 货币互换的定价第7章 期权定价  
 § 7.1 期权简介 § 7.2 期权的基本组合 § 7.3 股票期权价格的基本性质 § 7.4 期权定价的二项式方法 § 7.5 利用快速傅里叶变换 (FFT) 实现期权的二项式定价 § 7.6 Black-Scholes定价方法 § 7.7 期权定价的蒙特卡罗模拟方法 § 7.8 美式卖出期权的提前执行界 § 7.9 货币期权的定价 § 7.10 期货期权的定价第8章 信用衍生产品的定价方法 § 8.1 信用风险和信用衍生产品 § 8.2 信用违约互换 (CDS) 的定价 § 8.3 信用连锁票据的定价 § 8.4 信用利差期权的定价 § 8.5 其他的信用衍生产品  
 第9章 金融风险及其计算 § 9.1 风险和金融风险 § 9.2 金融风险的量化 § 9.3 灵敏度方法 § 9.4 用希腊字母度量风险 § 9.5 波动性方法 § 9.6 方差-协方差矩阵的计算第10章 风险价值及其计算方法 § 10.1 风险价值的定义 § 10.2 VaR计算的参数法 § 10.3 VaR估计的历史模拟法 § 10.4 VaR估计的蒙特卡罗模拟法 § 10.5 条件风险价值 (CVaR) § 10.6 VaR的扩展第11章 信用风险的度量方法  
 § 11.1 信用风险度量方法的发展 § 11.2 信用风险的度量 § 11.3 违约风险的统计精算法 § 11.4 度量违约风险的市场价格法 § 11.5 Merton模型 § 11.6 信用风险暴露 § 11.7 组合信用风险的度量第12章 投资组合选择方法——市场非系统风险的控制方法 § 12.1 Markowitz的投资组合理论 § 12.2 风险资产的选择与随机占优性 § 12.3 均值方差的投资组合选择 § 12.4 M-V有效投资组合的基本性质  
 § 12.5 M-V投资组合选择和有效边缘 § 12.6 不同风险度量下的投资组合选择模型 § 12.7 均值-风险价值 (M-VaR) 投资组合选择模型 § 12.8 考虑交易费用投资组合选择第13章 套期保值方法——市场系统风险的控制 § 13.1 套期保值与套头比 § 13.2 基差风险 § 13.3 最优套头比 § 13.4 最优套期保值方法 § 13.5 考虑交易费用的套期保值方法第14章 信用风险的控制和管理方法 § 14.1 信用风险定价的结构式模型 § 14.2 信用风险定价的简式模型 § 14.3 信用风险管理的CreditMetrics模型 § 14.4 信用风险管理的KMV模型 § 14.5 信用风险管理的CreditRisk+模型 § 14.6 信用风险管理的CreditPortfolioView模型参考文献

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>