

<<金融工程>>

图书基本信息

书名：<<金融工程>>

13位ISBN编号：9787030249036

10位ISBN编号：7030249038

出版时间：2009-7

出版时间：科学出版社

作者：庄新田 等著

页数：297

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

作为20世纪90年代金融领域的新兴学科，金融工程主要侧重于如何运用金融工具及衍生产品对金融风险（如股票风险、利率风险、外汇风险等）进行管理。

随着国际经济一体化的发展和金融工具的创新，金融工程已在金融领域得到了广泛应用。

金融工程技术强化了金融市场在资源配置中的核心作用，为满足不同投资者对金融产品多样化的需求提供了增强抗风险能力的投资工具，也为监管部门提供了新的金融监管方法，在保证市场的稳定运行方面发挥着积极作用。

目前，大多数人（包括许多金融界的从业人员）所了解的金融工程所应用的各种衍生证券，给人一种高风险、高投机的感觉。

他们对金融衍生品的认识与一系列灾难性的金融事件密切相关，如英国巴林银行破产、中国国债期货市场风波、1997年东南亚金融危机以及2008年源自美国的全球金融风暴。

人们对利用金融衍生品进行套利以及投机行为是“谈虎色变”。

因为各金融机构利用金融工程技术开发的金融衍生品定价比较复杂，很多人并不十分了解，并且对这些衍生品风险控制措施不力，难以监管，所以它们的应用增加了金融危机的广度和深度。

既然金融衍生品引发了这么多的灾难性事件，而且本质上衍生金融并不能产生新的社会价值，只是对社会财富进行一种再分配，那么为什么在世界范围内，衍生金融的市场还在不断扩大？

反观我国情况，尽管没有衍生金融，但是股票指数期货已经呼之欲出。

针对这个问题，不同背景的学者从各种角度进行了阐述。

本书的观点是，人们只有系统地学习金融工程的基本原理，在掌握各种金融工具及衍生产品特点和用途的基础上灵活运用，才能认识不断出现的金融创新产品，管理控制金融市场变化所产生的风险。

## &lt;&lt;金融工程&gt;&gt;

## 内容概要

《金融工程：原理、工具与应用》全面介绍了金融工程的原理、工具与应用，在结构安排上突破以往同类教材的范围，从金融投资及管理角度增加了一般性金融工具及投资管理的内容，系统介绍了各类金融工具及其衍生产品、工具组合技术及最新的风险管理技术，具体内容包括证券市场、资产组合理论、资产定价理论、行为金融理论、固定收益证券、股权收益证券、远期和期货基础、金融期货交易、期权基础、期权定价理论、互换交易、投资基金、投资管理、投资绩效评价等。

《金融工程：原理、工具与应用》体系完整，强调理论联系实际，且配有多媒体教学课件，适合作为高等院校经济管理类专业本科生教材，也可供金融实务界人士学习、参考。

## 书籍目录

前言第1章 绪论1.1 金融工程的产生及发展1.2 金融工程的研究内容1.3 金融工程的基本功能复习与思考  
第2章 证券市场2.1 证券市场概述2.2 证券交易程序和交易机制2.3 证券市场监管复习与思考第3章 资产  
组合理论3.1 证券投资收益与风险3.2 资产细会收益与风险3.3 资产组合的有效边界3.4 投资者效用函数  
与风险偏好3.5 无差异效用曲线与最优投资组合复习与思考第4章 资产定价理论4.1 资本资产定价模  
型4.2 因素模型4.3 套利定价理论4.4 有效市场理论复习与思考第5章 行为金融理论5.1 非有效市场理论5.2  
投资者心理与行为偏差5.3 行为金融投资策略复习与思考第6章 固定收益证券6.1 债券概述6.2 债券的定  
价6.3 影响债券投资价值的因素分析6.4 债券的利率期限结构6.5 债券的久期与风险管理6.6 债券投资组  
合管理复习与思考第7章 股权收益证券7.1 股票概述7.2 股利贴现模型——收入资本化法7.3 相对估价模  
型——比率分析法复习与思考第8章 远期和期货基础8.1 远期交易概述8.2 远期合约的定价8.3 远期交易  
的应用8.4 期货交易概述8.5 期货交易策略复习与思考第9章 金融期货交易9.1 外汇期货9.2 利率期货9.3  
股票指数期货复习与思考第10章 期权基础10.1 期权的基本概念10.2 期权交易盈亏平衡分析 ” 10.3 期权  
的价格特征10.4 期权交易策略复习与思考第11章 期权定价理论11.1 二叉树期权定价模型11.2  
B1ack-Scholes期权定价模型复习与思考第12章 互换交易12.1 互换交易概述12.2 利率互换12.3 货币互  
换12.4 互换的应用复习与思考 ” 第13章 投资基金13.1 投资基金概述13.2 投资基金的类型13.3 投资基金  
的实际操作和运用13.4 投资基金的选择复习与思考第14章 投资管理14.1 投资管理的方式与步骤14.2 对  
投资者特征的分析14.3 投资工具的选择14.4 投资者的资产配置复习与思考第15章 投资绩效评价15.1 投  
资绩效评价涉及的问题15.2 投资组合收益率的衡量15.3 风险调整后的业绩评估15.4 证券选择能力和市  
场时机选择能力复习与思考主要参考文献

## 章节摘录

第1章 绪论 1.1 金融工程的产生及发展 1.金融工程的概念 金融工程 (financial engineering) 一词最早出现在20世纪50年代的西方有关文献中,但作为一门科学则是在80年代末、90年代初发展起来的。

80年代末,美国金融学教授芬尼迪 (John Finnerty) 首次对金融工程给予界定。

1991年,国际金融工程师协会 (IAFE) 成立,该协会为非营利性组织,旨在为那些从事金融工程理论和实务的人提供联系和交流的途径,传播有关信息,加强对金融工程的教育和研究,促进该行业的发展。

金融工程是一门边缘性的新兴学科,它将现代工程方法和高新技术引入金融领域,综合运用各种工程的、信息的方法 (包括数学建模、数值计算、网络拓扑、仿真模拟、数据仓库等众多的现代信息技术),对金融产品进行设计、开发和实施操作,从而实现规避风险,并创造性地解决复杂环境下的各类金融问题。

一方面,金融工程依赖数值计算、图表和仿真技术;另一方面,它离不开金融市场的实践。

但是,对于什么是金融工程,金融学界有着不同的看法。

具有代表性的有: (1) 史密斯 (cifford w.smith) 教授和大通曼哈顿银行史密森 (charles w · Smithson) 经理认为:金融工程创造的是导致非标准现金流的金融合约,它主要指用基础的资本市场工具组合成新工具的过程。

.....

### 编辑推荐

《金融工程：原理、工具与应用》是根据教育部建设国家级精品课程的要求，由各学科领域全国知名教授领衔，精心编写而成。

各门课程按照立体化教学的需要进行建设，努力构建出一个包括主干教材、多媒体教学课件、教学参考用书、学生辅导用书、习题案例集、教学录像、教学支持网站等丰富教学支持资源的立体化教学体系。

选用该课程主干教材的教师可通过以下联系方式与出版社取得联系，以获得相关支持。

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>