

<<期权、期货及其他衍生产品>>

图书基本信息

书名：<<期权、期货及其他衍生产品>>

13位ISBN编号：9787115235459

10位ISBN编号：7115235457

出版时间：2010-8

出版单位：人民邮电出版社

作者：约翰·赫尔

页数：491

译者：张陶伟

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>

<<期权、期货及其他衍生产品>>

内容概要

本书曾被誉为人手一册的华尔街“圣经”，是全球高校学习衍生产品的畅销书。它是约翰·赫尔著的Options, Futures, And Other Derivatives 第6版的中译本。

本书内容全面，几乎囊括了金融衍生产品的所有理论知识。全书由浅入深，作者充分考虑了读者的数学背景，方便在校学生课堂上使用。书中各章自成体系，使具有不同需求的读者可有选择地阅读本书。

全书共32章，内容包括：期货市场的机制、期货套期保值策略、利率、利率期货、远期和期货价格的决定、互换、期权市场的机制、期权的交易策略、Black—Scholes—Merton模型、波动率微笑、数值方法、在险值、信用风险、信用衍生产品、奇异期权、凸性调整和实物期权等。

本书同先前的版本一样适于不同的用途，既适用于商学、经济学、投资学、金融工程专业的研究生，也适用于数学功底较好的本科高年级学生，对衍生品市场的金融从业人员、分析师、交易员或者其他的市场从业人员来说，本书也具有不可替代的参考价值。

<<期权、期货及其他衍生产品>>

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，Bonham金融中心主任。

国际公认的衍生品理论权威，发表了多部相关著作。

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、期货和其他衍生品》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 Fryeaward），并于1999年被国际金融工程师协会评选为年度金融工程师。

Hull教授还曾在约克大学、不列颠哥伦比亚大学、纽约大学、格连菲尔德大学、伦敦商学院任教。

<<期权、期货及其他衍生产品>>

书籍目录

技术说明

前言

第1章 绪论

第2章 期货市场的机制

第3章 利用期货套期保值策略

第4章 各种利率

第5章 远期和期货价格的决定

第6章 利率期货

第7章 互换

第8章 期权市场的机制

第9章 股票期权价格的性质

第10章 期权的交易策略

第11章 二叉树模型介绍

第12章 维纳过程和伊藤定理

第13章 Black-Scholes-Merton模型

第14章 股票指数期权、货币期权和期货期权

第15章 套期保值参数

第16章 波动率微笑

第17章 数值方法

第18章 在险值

第19章 估计波动率和相关系数

第20章 信用风险

第21章 信用衍生品

第22章 奇异期权

第23章 气象、能源和保险衍生品

第24章 关于模型和数值过程的进一步讨论

第25章 鞅和测度

第26章 利率衍生证券：标准市场模型

第27章 凸性调整、时刻调整及跨币衍生证券调整

第28章 利率衍生证券：短期利率模型

第29章 利率衍生品：HJM和LMM

第30章 互换的再次探讨

第31章 实物期权

第32章 衍生品灾难及教训

词汇表

Deriva Gem软件

主要期权、期货交易所表

当 $x \leq 0$ 时, $N(x)$ 表

当 $x > 0$ 时, $N(x)$ 表

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>