第一图书网, tushu007.com

<<金融工程>>

图书基本信息

书名：<<金融工程>>

13位ISBN编号：9787300107776

10位ISBN编号：730010777X

出版时间：2009-6

出版时间：中国人民大学出版社

作者：林清泉 编

页数：354

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

《金融工程》（第一版）已于2005年6月出版。
作者编写本教材的初衷是对那些刚刚进入金融工程专业学习的学生、希望拓宽自己视野的金融学和经济学专业的学生、已有一定工作经验但希望增长一些金融工程知识的金融业从业人员以及所有对金融工程这门新兴学科感兴趣的读者提供一定的帮助，本教材定位为金融工程的入门教材。
几年来，在该教材的使用过程中，笔者收到了读者提出的许多宝贵意见和建议。
根据反馈的意见，笔者对本教材做了进一步的修改和删减，使得该书能更好地满足读者的需要，一部分较难的内容将放到研究生教材中，有兴趣并有余力深入学习的读者可以参考相关教材。
本教材主要做了以下几个方面的修改：第三章将针对奇异期权的介绍内容改为附录，读者仅需了解即可，无须掌握；第四章对于相关矩阵函数的推导和证明等内容进行了删改，部分内容改为附录，同时略去了单指数模型这一节；第五章删除了一些需要较高数理基础的证明内容，同时也删除了经过改进的CAMP模型介绍部分，除此之外，本章还增加了一些如何应用CAPM的相关内容；第八章删除了存在交易费用的期权定价二叉树模型。
第九章第一节介绍了布莱克一斯科尔斯公式的证明思路，删除了求解偏微分方程的过程以及一些证明内容；第十六章增加了有关“次级债”的案例分析部分。
为了使教材内容能在54学时内讲授完，本次修订将原来的第十七章、第十八章精简掉，并安排在研究生教材中介绍。
在本教材的修订过程中，得到了黄伊宁、欧阳高文、石劭磊、吴代莉等人的热情帮助和无私的奉献，他们为修订工作的顺利完成付出了辛勤劳动，笔者在此表示衷心感谢！
同时，笔者还要感谢广大读者提出的宝贵意见，使得本教材得到了有针对性的修订。

内容概要

本书较为全面地介绍了金融工程的理论应用知识，而且结构上较为清晰、语言上比较浅显。
从框架结构上看，本书共由四篇组成——金融工程概述篇、金融工程理论篇、金融衍生产品篇和金融工程技术与管理篇。
金融工程概述篇主要介绍了金融工程的定义和分析方法、金融工程的产生和发展以及主要金融衍生产品的基础知识。
金融工程理论篇是本书的核心部分，主要内容包括资产组合理论、资产定价模型、有效市场理论、无套利分析方法和MM定理、期权及二叉树模型、布莱克-斯科尔斯期权定价理论。
金融衍生产品篇是以金融衍生产品不同的标的资产为分类标准，并由此分别介绍了以货币为基础的衍生产品、以利率为基础的衍生产品、以权益为基础的衍生产品。
金融工程技术与管理篇的主要内容包括汇率风险管理、股票风险管理、利率风险管理、信用风险管理和风险价值测算以及期权思想在公司财务中的应用，主要介绍可转换债券、股票期权以及实物期权。

作者简介

林清泉，中国人民大学财政金融学院教授、博士生导师，德国慕尼黑大学和莱比锡大学的高级访问学者，美国加利福尼亚大学圣塔芭芭拉分校经济系高级访问学者。
主要研究领域为金融工程、金融风险管理、金融资产定价、倒向随机微分方程及其在金融市场中的应用。

书籍目录

第一篇 金融工程概述篇 第一章 金融工程概述 第一节 金融工程的界定 第二节 金融工程的分析方法 第三节 金融工程和金融创新 第二章 金融工程的产生和发展 第一节 从金融学到金融工程学 第二节 金融工程发展的因素 第三节 金融工程的发展趋势 第四节 金融工程在中国的发展 第三章 金融工程和金融风险管理 第一节 金融工程和金融风险管理 第二节 金融风险管理的新工具——金融衍生工具 第二篇 金融工程理论篇 第四章 资产组合理论 第一节 传统的资产组合管理和现代资产组合理论 第二节 马科维茨的资产组合理论 第五章 资本资产定价理论 第一节 资本资产定价模型 第二节 套利定价模型 第六章 有效市场理论 第一节 有效市场假设概述 第二节 有效市场假设下的投资管理 第三节 有效市场假设的实证检验 第四节 研究市场有效性的重要方法——事件研究 第五节 我国股市有效性的游程检验 第七章 无套利分析方法 第一节 MM定理 第二节 状态价格定价方法 第三节 对可赎回债券价格的简单分析 第八章 期权的损益及二叉树模型 第一节 期权及其组合的损益 第二节 期权定价的二叉树模型 第三节 以债券为标的资产的期权定价二叉树模型 第四节 n期欧式期权的定价模型 第九章 期权定价公式及其应用第三篇 金融衍生产品篇 第十章 以货币为基础的衍生工具 第十一章 以利率为基础的衍生工具 第十二章 以权益为基础的衍生工具第四篇 金融工程技术与管理篇 第十三章 汇率风险管理 第十四章 利率风险管理 第十五章 股票价格风险管理 第十六章 信用风险管理

章节摘录

第一篇 金融工程概述篇　　第一章 金融工程概述　　第三节 金融工程和金融创新　　一、金融创新　　提起“创新”这个词，人们自然会想起经济学家熊彼特的“创新理论”。
熊彼特认为，所谓的“创新”活动是将生产要素和生产条件的“新组合”引入到生产体系中来。
具体说来，新产品的生产、新技术和新工艺的应用、新市场的开辟以及新的企业组织形式的建立都可以看做是创新活动。
现在人们经常提到的“金融创新”这个词，实际上就是把熊彼特的创新理论应用到金融领域而已。
一般来说，金融创新有广义和狭义之分。
从广义上说，金融创新是一个持续性过程，今天有关金融方面的一切，都是过去金融创新的结果，它包括金融市场、金融工具、金融制度、金融机构、金融管理甚至是金融理念方面的创新。
从狭义上说，金融创新是指20世纪70年代以来世界金融业的一次大规模创新浪潮，甚至“金融创新”这个名词本身就是20世纪70年代出现的一个新的名词组合。
对于狭义的金融创新，我们可从三个层次上理解：①对整个金融市场而言，金融创新是指对金融工具和交易方式所做的一些创新性改变；对金融监管机构而言，金融创新是指它允许金融机构办理过去未曾核准的新型金融业务；对金融机构而言，金融创新是指它以重新设计，或通过改良、组合等方式推出了过去未曾提供的余融工具与金融服务。

第一图书网, tushu007.com

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