

<<金融工程学>>

图书基本信息

书名：<<金融工程学>>

13位ISBN编号：9787302142355

10位ISBN编号：7302142351

出版时间：2007-1

出版时间：清华大学出版社

作者：黄辉

页数：215

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>

<<金融工程学>>

内容概要

本书简洁而又系统地介绍了金融工程的原理、方法和成果，内容覆盖了金融工程学的主要领域，包括金融工程的基本分析方法、重要的金融工程工具以及金融工程技术在风险管理中的应用等。

本书的主要适用对象是经济类专业的本科学生，亦可作为其他专业本科生学习此类课程的教科书，还可以作为研究生的参考用书。

<<金融工程学>>

书籍目录

第一章 金融工程导论	一、金融学工程的接合点	二、金融工程与金融创新	三、金融工程的逻辑基础	四、金融工程师的“工具箱”	五、金融工程的应用前景	六、本书的内容和结构
第二章 资产、投资与定价	第一节 金融资产与金融市场	一、债券	二、股票	三、汇	第二节 资产分散化：投资组合	一、资产组合的收益和风险
三、资产选择与投资决策	四、最小方差集与有效边界	五、市场指数模型与投资分散化	第三	节 资产定价的一般原理	一、资本资产定价模型 (CAPM)	二、套利定价理论 (APT)
附录一：两基金分离定理的证明	附录二：零 资本资产定价模型	第三章 金融工程的逻辑基础：无套利均衡	第一节 套利与均衡	一、无套利均衡分析的范例：一价定律和MM定理	二、套利组合	
第二节 无套利均衡分析	一、无套利均衡方法	二、复制技术	三、动态无套利均衡	四、状态价格与无套利均衡分析	第三节 市场的有效性完全性	一、市场的有效性
附录：资产定价的鞅方法	第四章 期权合约及其无套利均衡定价	第一节 期权概述	一、期权的含义和类型	二、期权的价格	三、期权交易的收益	第二节 期权定价的二项式模型
项式定价方法	第五章 布莱克—斯科尔斯期权定价模型	第一节 资产价格变化的特征	第二节 布莱克—斯科尔斯定价公式 (B—S公式)	一、B—S公式的数学形式	二、欧式期权看涨—看跌平价	三、资产支付孳息的期权定价公式
随机过程	第三节 布莱克—斯科尔斯微分方程	一、资产价格变化的	二、B—S微分方程	三、资产支付孳息的B—S方程	四、期权价格的敏感性	第一节 美式期权价格简析
关系	附录一：期权价格关系	附录二：资产价格存在跳跃性变动的期权定价	第一节 期权组合策略	一、期权与基础资产的基本组合	二、价差组合	三、跨式组合
第二节 奇异期权	一、合约条款变化型期权	二、路径依赖型期权	三、多种因素型期权	四、奇异期权定价简介	第七章 其他金融工程工具	第一节 远期利率协议与远期外汇综合协议
一、远期合约和远期价格	二、远期利率协议	三、远期外汇综合协议	第二节 金融期货及其定价	一、期货交易概览	二、短期利率期货	三、债券期货
第三节 金融互换及其定价	一、利率互换和货币互换的基本原理	二、互换的定价	第八章 金融工程技术与风险管理	第一节 金融风险及其管理方法	一、价格风险	二、套期保值
第二节 汇率风险管理	一、远期外汇合约及相关工具	二、外币期货合约	三、外币期权合约	第三节 利率风险管理	一、远期利率协议与短期利率期货	二、利率互换合约
期权的利率保值工具	第四节 风险管理：VaR方法	一、VaR的含义	二、VaR的计算	三、衍生工具的VaR计算	四、计算VaR的数值方法	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>