

<<金融工程学>>

图书基本信息

书名：<<金融工程学>>

13位ISBN编号：9787302147787

10位ISBN编号：7302147787

出版时间：2007-5

出版时间：清华大学出版社

作者：庄新田

页数：309

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

本书分为理论篇和应用篇。

理论篇从基础知识入手，系统介绍了各类金融工具尤其是衍生金融工具、工具组合技术及最新的风险管理技术，内容包括金融市场定价模型、远期、期货、期权、互换、典型金融创新产品及案例分析。

应用篇讲述了金融工程技术在资本市场的实际运用，帮助读者掌握金融衍生工具的分析技巧，开发投资者需要的新型金融产品。

通过应用篇的学习，能够培养学生分析问题和解决问题的能力，验证所学理论，达到理论与实践相结合的教学效果。

应用篇可以根据不同专业的要求，在讲授内容上加以筛选。

本书配有完整的电子课件和研讨资源（下载网址：<http://www.tupwk.com.cn/jrgxx/>），可供高等院校经济管理类专业学生使用，也适合于金融实务界人士学习使用。

## 书籍目录

理论篇 第1章 绪论 1.1 金融工程的概念及特点 1.1.1 金融工程的概念 1.1.2 金融工程的特点 1.1.3 金融工程处理问题的程序 1.2 金融工程的技术框架 1.3 金融工程的研究范围 1.4 金融工程的运作机理 1.5 金融工程与金融市场风险管理 本章小结 第2章 利率和利率期限结构 2.1 利率的确定 2.1.1 利率 2.1.2 远期利率 2.2 利率期限结构 2.2.1 债券的价格 2.2.2 到期收益率 2.2.3 零息债券 2.2.4 久期 2.2.5 凸度 2.2.6 收益率曲线 2.3 传统利率期限结构理论 2.3.1 期望理论 2.3.2 流动性偏好理论 2.3.3 市场分割理论 2.3.4 优先置产理论 2.4 现代利率期限结构理论 2.4.1 折现因子模型 2.4.2 单因子模型 本章小结 复习与思考 第3章 无套利定价分析 3.1 MM理论 3.1.1 传统资本结构理论 3.1.2 MM理论 3.2 无套利定价的数学定义 3.3 状态价格的定价方法 3.4 无套利定价与资本资产定价理论 3.5 无套利定价理论的应用 3.5.1 金融工具的模仿 3.5.2 金融工具的合成 本章小结 复习与思考 第4章 投资组合理论 4.1 投资组合理论的产生和发展 4.1.1 投资组合理论产生的背景 4.1.2 传统投资组合理论 4.1.3 现代投资组合理论的产生和发展 4.2 马克维茨的投资组合理论 4.2.1 马克维茨投资组合理论的基本假设 4.2.2 投资组合的收益和风险 4.2.3 风险的分散化 4.2.4 两基金分散定理 4.3 资本资产定价模型 (CAPM) 4.3.1 假设条件 4.3.2 资本市场线 4.3.3 证券市场线 4.3.4 对传统CAPM模型的评价和改进 4.4 因素模型与套利定价理论 4.4.1 因素模型 4.4.2 对定价的影响 4.4.3 双因素模型 4.4.4 多因素模型 ..... 第5章 金融远期交易 第6章 金融期货基础 第7章 利率期货与股票指数期货 第8章 期权基础 第9章 期权定价理论 第10章 外汇期货与外汇期权 第11章 互换交易应用篇 第12章 基于VaR风险指标的投资组合模糊优化 第13章 银行资产负债管理的优化 第14章 多阶段金融资产配置模型及其应用 第15章 股票市场流动性研究 第16章 投资基金绩效评级方法 第17章 基于双因素的可转换债券定价 第18章 认购权证与标的股票的协整分析 第19章 公司股权结构与经营绩效相关性分析参考文献

#### 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>