

<<金融衍生产品>>

图书基本信息

书名：<<金融衍生产品>>

13位ISBN编号：9787302161035

10位ISBN编号：7302161038

出版时间：2007-9

出版时间：清华大学

作者：邬瑜骏 黄丽清 汤震宇

页数：261

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>

<<金融衍生产品>>

内容概要

本书囊括了几乎所有衍生金融工具的杰出理论成果，涉及期货、远期、期权、互换以及许多由其衍生出来的变形品种。

此外，此书还介绍了世界上应用最为广泛的衍生金融工具——货币及利率衍生产品。

通过本书，你将学会如何运用这些工具及其投资组合来管理金融风险。

本书全面系统，实务性强，通俗易懂，习题丰富，涉足前沿领域。

适合广大备战CFA的考生和金融、投资等相关专业的本科生、硕士生、MBA以及金融人士使用，亦是风险管理从业人员的优秀操作指南。

<<金融衍生产品>>

作者简介

邬瑜骏：金程教育副校长，FRM首席培训师。

新加坡南洋理工大学金融学博士，特许金融分析师（CFA）持证人，美国风险管理师（FRM）持证人，FRM考试全球命题人，硕士生导师。

先后任教于南洋理工大学南洋商学院，复旦大学经济学院国际金融系，厦门大学财务管理和会计研究院

<<金融衍生产品>>

书籍目录

基础篇金融产品 第1章 衍生产品市场简介 学习目标 1.1 衍生产品市场的概况 1.2 衍生产品市场的历史 1.3 衍生产品市场的功能 1.4 衍生产品市场交易者的类型 1.5 对衍生产品市场的指责 1.6 衍生产品定价的基本原理 第2章 远期市场和远期合约 学习目标 2.1 远期合约 2.2 几种主要的远期合约 2.3 远期合约的定价 2.4 远期合约市场 练习题 练习题参考答案 第3章 期货市场和期货合约 学习目标 3.1 期货合约 3.2 几种主要的期货合约 3.3 期货合约的定价 3.4 期货合约市场 练习题 练习题参考答案 第4章 期权市场和期权合约 学习目标 4.1 期权合约 4.2 几种主要的期权合约 4.3 期权合约的定价 练习题 练习题参考答案 第5章 互换市场和互换合约 学习目标 5.1 互换合约的类型 5.2 互换合约的定价 5.3 互换合约的创新 5.4 互换期权 5.5 互换合约的信用风险 练习题 练习题参考答案 第6章 利率衍生产品 第7章 信用衍生产品 第8章 奇异期权提高篇 产品定价 第9章 Black-Scholes期权定价模型 第10章 期权定价的二叉树模型 第11章 期权价格的风险因素应用篇 风险管理 第12章 基于期货和远期合约的风险管理策略 第13章 基于期权合约的风险管理策略 第14章 基于互换合约的风险管理策略 参考文献附录 中英文对照术语表

章节摘录

基础篇金融产品 第1章 衍生产品市场简介 1.1 衍生产品市场的概况 当今金融衍生产品市场 (derivative markets) 主要可以分为交易所交易市场 (exchange—traded market) 和柜台交易市场 (over-the-counter market) 两类。

交易所交易的金融衍生产品主要包括远期利率协议 (FRA)、期权 (options), 股票类期货和期权 (个股期货和期权、股指期货和期权), 外汇期货和期权 (currency futures and options)。

近年来掉期期货 (swap futures)、交易所指数基金期货 (index fund futures) 等新产品也在发达国家的交易所中交易活跃。

柜台衍生产品交易主要是指金融机构与其客户或金融机构之间针对利率 (interest rate)、外汇 (currency)、股票 (stock) 及股票指数 (stock indices) 等进行套期保值 (hedging)、规避风险或投机 (speculation) 的交易。

其中, 利率类产品交易占据了主导地位, 这主要是因为金融机构和其客户之间的合作主要体现为借贷类业务, 而借贷类业务与利率风险是紧密联系在一起。

根据国际清算银行 (Banking for International Settlements, BIS) 的统计, 2006年9月在交易所 (organized exchanges) 内交易的金融衍生产品期末账面余额为75.58万亿美元, 比2005年底的57.82万亿美元增长了17.76万亿美元; 2006年6月在柜台市场 (OTC) 上金融衍生产品期末账面余额达到369.91万亿美元, 比2005年6月的281.49万亿同比增长了31.41%。

金融衍生品市场作为一个新兴市场, 在价格发现 (price discovery)、风险规避和增加投资组合的选择性等方面发挥着越来越重要的作用, 同时也对国际金融市场产生了深刻的影响。

编辑推荐

注册金融分析师（CFA R）资格考试被称作“全球金融第一考”，CFA R是当今世界证券投资与管理界普遍认可的一种职业称号。

目前，中国高级金融人才奇缺，金融分析师更是存在着巨大的供需缺口，越来越多的中国金融从业人员关注和学习CFA R的知识体系，每年报考CFA R的人数呈递增趋势。

本系列丛书的出版将促进最新金融理论和方法的传播，具有实用性、通俗性、创新性。不仅仅是中国参加CFA R应试的各级考生辅导丛书，而且有助于金融分析人员、投资组合管理人员及有志于在金融领域有所发展的金融爱好者掌握CFA R的知识体系和伦理规范、现代组合管理和投资分析的规范与理念，也是了解国际通行做法的一个窗口。

——国务院发展研究中心名誉主任，综合开发研究院（中国·深圳）理事长马洪

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>