

图书基本信息

书名：<<金融衍生产品的性质、定价与风险管理>>

13位ISBN编号：9787305083617

10位ISBN编号：7305083615

出版时间：2011-6

出版时间：南京大学出版社

作者：孙宁华

页数：304

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>

## 内容概要

《金融衍生产品的性质定价与风险管理》由孙宁华所著。

《金融衍生产品的性质定价与风险管理》探讨了金融衍生产品市场交易过程中的信息不对称问题及其引发的逆向选择和道德风险，构建了交易员道德风险模型和交易所道德风险模型；分析了衍生品微观风险向宏观风险传导的三种可能路径；回顾了百年期权定价的发展历程，并着力考察了期权定价的前沿理论——基于等鞅测度的期权定价；研究了衍生产品风险度量和管理技术：灵敏度分析、VaR方法和基于g-h分布的分位数回归等；提出了防范和化解衍生产品风险的制度安排。

书籍目录

- 第一章 金融衍生产品的运行机制与发展概况
  - 第一节 金融衍生产品的运行机制
  - 第二节 金融衍生产品的功能
  - 第三节 国际金融衍生市场发展状况
  - 第四节 中国发展金融衍生产品的历程
- 第二章 逆向选择、道德风险与金融衍生产品风险形成
  - 第一节 金融衍生产品风险的类型
  - 第二节 信息不对称与逆向选择和道德风险
  - 第三节 逆向选择、道德风险与金融衍生产品风险
  - 第四节 金融衍生交易中的道德风险典型案例剖析
- 第三章 金融衍生产品宏观风险形成
  - 第一节 市场失灵、规则缺失与衍生产品风险传导
  - 第二节 衍生产品虚拟性与契约性的交互作用与风险传导
  - 第三节 对冲基金与衍生市场宏观风险形成和传导
  - 第四节 信用衍生产品与美国次贷及全球金融危机
- 第四章 金融衍生产品定价：基本理论
  - 第一节 线性衍生产品的定价
  - 第二节 期权定价理论
  - 第三节 股指期货定价理论
  - 附录 Black-Scholes定价公式的推导(风险中性定价方法)
- 第五章 期权定价：B-S模型之后的发展
  - 第一节 认股权证、股指期货、货币期权、期货期权的定价
  - 第二节 美式期权
  - 第三节 其他假设的放宽
  - 附录 B-S期权定价公式是二项式期权定价公式的特例
- 第六章 基于等鞅测度的期权定价
  - 第一节 测度的建立
  - 第二节 等鞅测度
  - 第三节 Merton连续股息下的欧式看涨期权定价：鞅方法
  - 第四节 期权定价鞅方法的拓展与运用
- 第七章 金融衍生产品风险度量：从灵敏度到VaR
  - 第一节 金融衍生产品敏感性度量
  - 第二节 VaR：风险价值
  - 第三节 对VaR的发展：分位数回归法
- 第八章 金融衍生产品风险预警指标体系与运作机制
  - 第一节 金融衍生产品风险评估指标体系
  - 第二节 金融衍生产品风险预警方法
  - 第三节 金融衍生产品风险预警系统的运作
- 第九章 防范金融衍生产品风险的制度安排
  - 第一节 制度、风险与经济绩效
  - 第二节 衍生市场运行的规则
  - 第三节 交易商的自我管理和自律管理
  - 第四节 衍生产品的监管安排
  - 第五节 防范对冲基金的制度安排
- 第十章 中国衍生市场风险形成和管理

第一节 中国衍生市场风险成因分析

第二节 中国衍生市场规范与发展

参考文献

后记

编辑推荐

《金融衍生产品的性质定价与风险管理》共分十章，主要介绍了金融衍生产品的运行机制与发展概况，金融衍生产品宏观风险形成，基于等鞅测度的期权定价，金融衍生产品风险度量：从灵敏度到VaR，防范金融衍生产品风险的制度安排，中国衍生市场风险形成和管理等内容。

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>