

<<金融工程概论>>

图书基本信息

书名：<<金融工程概论>>

13位ISBN编号：9787307067844

10位ISBN编号：7307067846

出版时间：2009-7

出版时间：武汉大学出版社

作者：叶永刚

页数：462

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

在赤日炎炎的盛夏，在美丽的珞珈山水之间，我伏在案头，奋笔书写第二版前言。

我的心情，像窗外的空气一样，热浪滚滚。

我记得1999年7月12日，我在珞珈山写下了第一版的前言。

时隔十年，我又坐在这里，写着第二版的前言。

十年，在历史的长河中，只是短暂的一瞬。

可是，我们的金融工程，却在华夏大地发生了极大的变化。

1996年至1997年，我在美国康奈尔大学进修。

那时，金融工程在美国刚刚兴起。

1997年底，我在美国将所有能收集到的关于金融工程的教材和文献都带回了武汉大学。

当年，我就在武汉大学开设了这门课程。

2001年底，我们向教育部写了申请报告，建议在中国高校的本科生中开设该学科。

教育部为此专门组织了专家论证会。

专家们通过无记名投票，一致通过了该报告。

2002年，武汉大学和首批试办的其他高校一起，招收了中国高校的第一批金融工程本科生。

第一批金融工程的本科生诞生之时，国内外有不少人对此持批评和怀疑态度，认为中国的本科生难以学好本专业。

7年过去了，中国教育部最近公布了一项大学本科生的就业调查结果，在全国就业最好的60个本科专业中，金融工程名列榜首。

短短的7年时间，金融工程专业不仅得到了全国高校的认同，而且也受到了全社会的普遍欢迎。

中国金融工程学科的开设，为中国的金融发展培养了一批又一批急需人才。

我们不仅培养了本科生，而且培养了硕士生和博士生。

我们在金融工程的教学过程中，想到了教材的修订。

我们的修订工作开始于2004年初。

直到今天，我们才完成了此项工作。

这次修订，我们做了较大的修改。

如果说在第一版中，我们对金融工程的理解，主要限于工具论层面的话，那么，在这次修订中，我们则将金融工程拓展到了结构论的层面。

<<金融工程概论>>

内容概要

从本书的结构看，作者们经过反复比较后，基本上采用了约翰·马歇尔和维普尔·班赛尔的总体框架，即全书分为四大部分。

第一大部分为概论，第二大部分为理论工具，第三大部分为实体工具，第四大部分为金融策略。

尽管大的框架与这个版本基本相同，但对具体内容和章节的安排却作了很大的调整和修改。

在概论部分，作者们增加了对金融工程方法论的分析。

在理论部分，作者们主要从金融工程的目的出发作出安排。

金融工程最重要的目的是盈利，并尽可能地减少风险。

因此，理论部分主要分析了现金流、收益和风险方面的内容。

在第三部分，作者们主要论述了各种实体金融工具。

在这部分的写作中，我们尽可能把金融工具的分析与中国的金融实践相结合。

在第四部分，作者们仅就金融工程中使用最为普遍的几种策略作了介绍，即资产负债管理、公司重组与公司避税理财。

在章节的安排上，作者们尽可能地考虑了教学的需要。

每一章都安排了小结、参考阅读、练习与思考。

本书作为一本概论性的教材，并没有涉及很多高深的数学问题。

作者们将部分公式的推导放在附录中。

读者即使跳过这些数学公式，也并不影响对本书基本内容的理解和把握。

<<金融工程概论>>

书籍目录

第一编 金融工程概述 第一章 金融工程导论 第一节 金融工程的概念 第二节 金融工程与金融工具 第三节 金融工程与风险管理 第四节 国外和港台地区金融工程专业课程设置及对中国大陆的启示 第五节 本书结构 第二章 金融工程与积木分析法 第一节 金融价格风险分析 第二节 远期合约分析 第三节 期货合约分析 第四节 互换合约分析 第五节 期权合约分析 第六节 金融积木综合分析 第二编 金融工具 第三章 现货工具 第一节 商品市场 第二节 外汇市场 第三节 货币市场 第四节 债券市场 第五节 股票市场 第六节 现货工具综合配置分析 第四章 远期工具 第一节 远期交易概述 第二节 远期工具的定价 第三节 远期利率协议 第四节 远期外汇交易 第五节 远期汇率协议 第六节 人民币远期结售汇 第七节 远期工具综合配置分析 第五章 期货工具 第一节 期货交易概述 第二节 期货定价 第三节 商品期货 第四节 外汇期货 第五节 利率期货 第六节 股指期货 第七节 期货工具综合配置分析 第六章 互换工具 第一节 互换交易概述 第二节 互换定价 第三节 利率互换 第四节 货币互换 第五节 互换工具综合配置分析 第七章 期权工具 第一节 期权交易概述 第二节 期权定价 第三节 外汇期权 第四节 利率期权 第五节 股指期权 第六节 股票期权 第八章 混合工具 第三编 金融风险 第九章 商品价格风险管理 第十章 外汇风险管理 第十一章 利率风险管理 第十二章 股票价格风险管理 第十三章 信用风险管理 第十四章 金融工程的应用——操作风险管理

章节摘录

第一章 金融工程导论 学习目标 1. 金融工程的基本概念 2. 金融工程使用的金融工具
3. 金融工程与风险管理 第一节 金融工程的概念 一般认为, 金融工程是20世纪80年代末和90年代初在金融创新的基础上发展起来的一门新兴学科。

“新兴”使该学科具有了极强的生命力, 同样, “新兴”也造成了人们对这门学科从整体上把握的困难。

人们对金融工程的界定正处在探索和深化过程中。

目前我们所能见到的有关金融工程的定义可从两本书中得到, 一本是英国洛伦兹·格利茨所著的《金融工程学》, 一本是美国约翰·马歇尔和维普尔·班赛尔所著的《金融工程》。

前者已由唐旭等人译出, 经济科学出版社1998年8月出版。

后者已由宋逢明等人译出, 清华大学出版社1998年6月出版。

我们先看洛伦兹·格利茨的定义: “金融工程是应用各种金融工具, 将现有的金融结构进行重组以获得更为理想的结果。

” “工程”一词原指机械工程。

机械工程离不开工具。

它指的是将某一个工具单独使用来解决某一个问題, 或将一个工具与另一个工具组合起来, 更有效地解决某一问题, 或者, 为了某种功能的完善而进行相应的调整。

金融工程正是利用金融工具与机械工具的相似性而借用了机械工程的概念。

金融工程所使用的金融工具, 既包括各种现货金融工具, 也包括各种衍生金融工具。

现货金融工具主要指外汇市场交易、货币市场交易、债券市场交易和股票市场交易等。

衍生金融工具主要指远期交易、期货交易、期权交易和互换交易等。

像机械工程师一样, 金融工程师要么单独使用这些工具的某一种来解决金融财务问题, 要么将这些工具中的某几种综合起来解决问题, 要么将某种工具或某几种工具的功能进行相应的调整来解决问题。

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>