

<<期权、期货和衍生证券>>

图书基本信息

书名：<<期权、期货和衍生证券>>

13位ISBN编号：9787508011929

10位ISBN编号：7508011929

出版时间：1997

出版时间：华夏出版社

作者：(美)约翰.赫尔

译者：张陶伟

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>

<<期权、期货和衍生证券>>

书籍目录

- 目录
- 前言
- 第一章 介绍
 - 1.1 远期合约
 - 1.2 期货合约
 - 1.3 期权
 - 1.4 其它衍生证券
 - 1.5 交易者的类型
 - 1.6 小结
- 第二章 期货市场和期货合约套期保值应用
 - 2.1 期货合约的交易
 - 2.2 期货合约的特性
 - 2.3 保证金的操作
 - 2.4 报纸行情
 - 2.5 期货价格收敛于现货价格
 - 2.6 现金结算
 - 2.7 利用期货套期保值
 - 2.8 最佳套期比率
 - 2.9 向前延展的套期保值
 - 2.10 小结
- 第三章 远期和期货价格
 - 3.1 某些预备知识
 - 3.2 无收益证券的远期合约
 - 3.3 支付已知现金收益证券的远期合约
 - 3.4 支付已知红利率证券的远期合约
 - 3.5 一般结论
 - 3.6 远期价格和期货价格
 - 3.7 股票指数期货
 - 3.8 货币的远期和期货合约
 - 3.9 商品期货
 - 3.10 持有成本
 - 3.11 交割选择
 - 3.12 期货价格和预期将来的即期价格
 - 3.13 小结
- 附录3A：当利率为常数时，远期价格与期货价格相等的一个证明
- 第四章 利率期货
 - 4.1 某些预备知识
 - 4.2 长期和中期国债期货
 - 4.3 短期国债期货
 - 4.4 欧洲美元期货
 - 4.5 久期
 - 4.6 基于久期的套期保值策略
 - 4.7 久期的局限性
 - 4.8 小结

<<期权、期货和衍生证券>>

第五章 互换

- 5.1 利率互换的机制
- 5.2 利率互换的定价
- 5.3 货币互换
- 5.4 货币互换的定价
- 5.5 其它互换
- 5.6 信用风险
- 5.7 小结

第六章 期权市场

- 6.1 期权交易所
- 6.2 场外交易的期权
- 6.3 期权合约的性质
- 6.4 报纸上的期权行情
- 6.5 交易
- 6.6 保证金
- 6.7 期权清算公司
- 6.8 认股权证和可转换债券
- 6.9 小结

第七章 股票期权价格的特征

- 7.1 影响期权价格的因素
- 7.2 假设和符号
- 7.3 期权价格的上下限
- 7.4 提前执行：不付红利股票的看涨期权
- 7.5 提前执行：不付红利的看跌期权
- 7.6 看跌与看涨期权之间平价关系
- 7.7 红利的影响
- 7.8 实证研究
- 7.9 小结

第八章 期权的交易策略

- 8.1 包括一个简单期权和一个股票的策略
- 8.2 差价期权
- 8.3 组合期权
- 8.4 其他复合期权的损益状态
- 8.5 小结

第九章 股票价格行为的一种模式

- 9.1 马尔科夫性质
- 9.2 维纳过程
- 9.3 股票价格的行为过程
- 9.4 模型回顾
- 9.5 参数
- 9.6 二叉树模型
- 9.7 小结

第十章 Black - Scholes模型的分析

- 10.1 ITO定理
- 10.2 股票价格的对数正态分布特性
- 10.3 收益率的分布
- 10.4 从历史数据估计的波动率

<<期权、期货和衍生证券>>

- 10.5利用简单二叉树模型对期权定价
- 10.6Black - Scholes微分方程的基本概念
- 10.7Black - Scholes微分方程的推导
- 10.8风险中性定价
- 10.9Black - scholes定价公式
- 10.10累积正态分布函数
- 10.11公司发行的本公司股票认股权证
- 10.12隐含波动率
- 10.13波动率产生的原因
- 10.14红利
- 10.15小结
- 附录10A：ITO 定理的推导
- 附录10B：计算基于支付红利股票的美式看涨期权价值的精确步骤
- 第十一章 股票指数期权、货币期权和期货期权
- 11.1支付已知红利股票的期权
- 11.2股票指数期权
- 11.3货币期权
- 11.4期货期权
- 11.5小结
- 附录11A：基于支付连续红利率股票衍生证券所满足的微分方程的推导
- 附录11B：基于期货价格衍生证券所满足的微分方程的推导
- 第十二章 衍生证券定价的一般性方法
- 12.1单一基本变量
- 12.2利率风险
- 12.3基于几个状态变量的证券
- 12.4基于商品价格的衍生证券
- 12.5交叉货币期货和期权
- 12.6小结
- 附录12A：ITO 定律的一般表示式
- 附录12B：推导衍生证券所满足的一般微分方程
- 第十三章 期权与其它衍生证券的保值
- 13.1一个例子
- 13.2裸期权头寸与抵补期权头寸
- 13.3止损策略
- 13.4更复杂的保值策略
- 13.5Delta套期保值
- 13.6Theta
- 13.7Gamma
- 13.8Delta , Theta和Gamma之间的关系
- 13.9Vega
- 13.10RHO
- 13.11实际中的期权组合套期保值
- 13.12有价值证券组合的保险
- 13.13小结
- 附录13.A 台劳展开和对冲参数

<<期权、期货和衍生证券>>

第十四章 数值方法

- 14.1 蒙特卡罗模拟
- 14.2 二叉树
- 14.3 指数期权、货币期权和期货期权的二叉树法
- 14.4 支付已知红利的股票期权的二叉树法
- 14.5 基本二叉树方法的扩展
- 14.6 避免负的概率
- 14.7 有限差分方法
- 14.8 期权定价的解析近似方法
- 14.9 小结

附录14A：MAC MILKAN，BARONE - ADESI和WHALEY
的美式期权价格的解析近似方法

第十五章 利率衍生证券

- 15.1 交易所内的债券期权
- 15.2 嵌入债券的期权
- 15.3 有抵押的证券
- 15.4 互换期权
- 15.5 利率上限
- 15.6 债券期权估值的简单方法
- 15.7 简单模型的局限性
- 15.8 研究人员构造期限结构所采用的传统方法
- 15.9 Rendleman和Bartter模型
- 15.10 均值回复
- 15.11 Vasicek模型
- 15.12 Cox，Ingersoll和Ross模型
- 15.13 两因素模型
- 15.14 无套利模型
- 15.15 Heath，Jarrow和Morton 方法
- 15.16 Ho和Lee模型
- 15.17 Hull和White模型
- 15.18 套期保值
- 15.19 小结

第十六章 新型期权

- 16.1 新型期权的类别
- 16.2 基本定价工具
- 16.3 美式路径依赖型期权
- 16.4 基于两个相关资产的期权
- 16.5 套期保值讨论
- 16.6 小结

第十七章 Black - Scholes期权定价的几种方法

- 17.1 利率和波动率变化已知的修正
- 17.2 Merton随机利率模型
- 17.3 偏差的定价
- 17.4 几个模型
- 17.5 定价偏差的回顾
- 17.6 实证研究
- 17.7 在实际中如何利用这些模型

<<期权、期货和衍生证券>>

17.8小结

附录17A：几个模型的定价公式

第十八章 信用风险

18.1资产暴露的性质

18.2确定资产的合约

18.3可能是资产或负债的合约

18.4国际清算银行的资本充足要求

18.5减少违约风险

18.6小结

第十九章 关键概念的回顾

19.1无风险的套期保值

19.2可交易证券和其它标的变量

19.3风险中性化定价

19.4 结束语

附表：当 $X \rightarrow 0$ 时 $N(x)$ 表

附表：当 $X \rightarrow 0$ 时 $N(X)$ 表

世界交易所名称

各种符号的总结

注释

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>