

<<金融工程方法及应用>>

图书基本信息

书名：<<金融工程方法及应用>>

13位ISBN编号：9787563811755

10位ISBN编号：7563811753

出版时间：2005-6

出版时间：首都经济贸易大学出版社

作者：田新民

页数：238

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>

## <<金融工程方法及应用>>

### 内容概要

理解金融工程的开始是理解金融产品。

金融产品的两个特征是收益率和风险，金融产品通过现金流列这个载体体现其特征。

认真理解现金流列的载体概念是非常重要的，只有这样，才能弄清楚收益率和 risk 的概念及内涵，才能知道如何度量收益率和风险。

才能理解金融工程方法的基础，这些是本书第一章和第二章的内容。

制造产品的关键在技术，金融工程的关键在金融工程技术。

金融工程基本方法是无套利定价原理和风险中性定价原理。

为了理解这些原理，我们必须透过特征看载体，透过载体看所有金融产品的内核或基础，这就是基准利率、风险溢价和汇率。

在金融工程基本方法框架下，金融工程技术包括组合、分解和复制等，通过这些技术，金融产品被源源不断地制造出来。

这些是本书第三章的内容。

本书第四章介绍了金融产品的价格特征。

通过学习，可以了解股票这种基本产品以及衍生产品的价格特征，理解股票及衍生产品现金流列的特征。

第五章在第四章的基础上，介绍了以布莱克-斯科尔斯公式为代表的现代金融工程的标志性成果，介绍了如何将金融工程方法和技术运用于资产定价。

本书后面的四章是金融工程方法和技术的运用，每一章是一个独立主题。

第六章介绍资产配置理论及应用；第七章介绍投资组合管理的动态调整；第八章介绍指数化投资理论与产品设计；第九章介绍信用风险分析模型。

## &lt;&lt;金融工程方法及应用&gt;&gt;

## 书籍目录

前言?第一章 金融资产收益? 1.1 金融资产? 1.2 金融市场? 1.3 金融资产的收益率? 1.4 利率期限结构?第二章 金融资产风险? 2.1 风险? 2.2 金融产品的风险? 2.3 金融资产风险的度量?第三章 金融工程基本方法? 3.1 金融工程的定义? 3.2 金融工程产生和发展背景? 3.3 套利及无套利定价方法? 3.4 风险中性定价? 3.5 状态价格模型?第四章 资产价格运行模式? 4.1 多期二叉树模型? 4.2 加法模型? 4.3 乘法模型? 4.4 参数计算和选择? 4.5 随机游走和维纳过程? 4.6 一个股票价格过程? 4.7 伊藤引理?第五章 布莱克-斯科尔斯期权定价公式? 5.1 期权的价格特征? 5.2 期权平价公式? 5.3 布莱克-斯科尔斯方程? 5.4 风险中性定价? 5.5 布莱克-斯科尔斯期权定价公式? 5.6 布莱克-斯科尔斯期权定价公式的拓展? 5.7 鞅定价?第六章 资产配置理论及应用? 6.1 资产配置的一般过程? 6.2 资产配置决策的重要性??第七章 投资组合管理的动态调整? 7.1 投资组合动态策略及比较分析? 7.2 不同策略的实证对比分析?第八章 指数化投资理论与产品设计? 8.1 指数化投资理论? 8.2 指数化投资的理论基础? 8.3 指数产品及其编制? 8.4 增强型产品介绍? 8.5 增强型产品设计原理? 8.6 理论实施? 8.7 程序化设计思想? 8.8 产品实证?第九章 信用风险分析模型研究? 9.1 信用风险概述? 9.2 结构模型?参考文献?

<<金融工程方法及应用>>

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>