

<<金融工程学>>

图书基本信息

书名：<<金融工程学>>

13位ISBN编号：9787565405747

10位ISBN编号：7565405744

出版时间：2011-11

出版时间：东北财经大学出版社有限责任公司

作者：李健元 等主编

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>

## <<金融工程学>>

### 内容概要

《国家级特色专业东北财经大学金融学系列教材：金融工程学》内容包括资产定价基础知识、基础金融工具；远期合约、远期利率和FRA；远期外汇合约和SAFE交易等内容。

《国家级特色专业东北财经大学金融学系列教材：金融工程学》既有对金融工程相关产品相对复杂、枯燥的定价及理论的介绍，又有真实、鲜活的案例分析，并利用相关数据对近年国内外金融市场的多个案例进行了深入剖析。

## &lt;&lt;金融工程学&gt;&gt;

## 书籍目录

## 第1章

资产定价基础知识、基础金融工具

学习目标

1.1 无套利均衡原理和一价定律

1.2 利息的计算方法

1.3 资金的时间价值

1.4 现货市场

本章小结

关键概念

综合训练

## 第2章

远期合约、远期利率和FRA

学习目标

2.1 远期合约

2.2 远期利率

2.3 远期利率协议

本章小结

关键概念

综合训练

## 第3章

远期外汇合约和SAFE交易

学习目标

3.1 远期外汇合约

3.2 掉期交易

3.3 综合的远期外汇协议

本章小结

关键概念

综合训练

## 第4章

金融期货交易规则与定价

学习目标

4.1 期货市场简介

4.2 金融期货合约

4.3 金融期货定价机制

4.4 金融期货交易中的套期保值

本章小结

关键概念

综合训练

## 第5章

久期和凸度

学习目标

5.1 久期

5.2 凸度

本章小结

关键概念

## <<金融工程学>>

综合训练

### 第6章

利率期货

学习目标

6.1 利率期货概述

6.2 短期利率期货合约

6.3 中长期利率期货合约

6.4 国际金融市场主要利率期货品种

6.5 利率期货的定价

6.6 利率期货的套利

6.7 利率期货的套期保值

本章小结

关键概念

综合训练

### 第7章

外汇期货

学习目标

7.1 外汇期货概述

7.2 外汇期货定价

7.3 外汇期货的应用

本章小结

关键概念

综合训练

### 第8章

股指期货

学习目标

8.1 股指期货概述

8.2 股指期货的运作

8.3 股指期货的定价与投资

本章小结

关键概念

综合训练

### 第9章

互换交易

学习目标

9.1 互换概述

9.2 利率互换

9.3 货币互换

9.4 其他互换

9.5 互换的应用

本章小结

关键概念

综合训练

### 第10章

互换定价

学习目标

10.1 利率期限结构

<<金融工程学>>

10.2 零息票利率、远期利率与互换利率

10.3 互换定价

本章小结

关键概念

综合训练

第11章

期权交易基础

学习目标

11.1 期权概述

11.2 期权的类型

11.3 期权交易

本章小结

关键概念

综合训练

第12章

期权定价理论

学习目标

12.1 期权价格概述

12.2 布莱克-斯科尔斯(B-S)模型

12.3 二项式定价模型

12.4 期权价格上下限

12.5 看涨看跌期权平价

12.6 期权定价的红利因素

本章小结

关键概念

综合训练

第13章

期权交易策略

学习目标

13.1 单一期权

13.2 期权与基础资产组合

13.3 价差期权组合

13.4 组合期权

本章小结

关键概念

综合训练

第14章

期权品种

学习目标

14.1 货币期权

14.2 利率期权

14.3 股票期权

14.4 股票指数期权

14.5 衍生期权

本章小结

关键概念

综合训练

<<金融工程学>>

第15章

金融工程交易案例集

15.1 股票累积期权案例

15.2 中信泰富澳元外汇累积期权案例

15.3 东航燃油套期保值巨亏案例

15.4 深南电原油累积期权对赌案例

15.5 中国远洋做多BDI指数高位被套巨额浮亏案例

15.6 中航油场外石油期权交易巨亏案例

15.7 巴林银行日经225指数期权交易巨亏倒闭案例

15.8 国储铜事件

主要参考文献

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>