

<<金融工程学>>

图书基本信息

书名：<<金融工程学>>

13位ISBN编号：9787810780339

10位ISBN编号：7810780336

出版时间：2000-10

出版时间：对外经济贸易大学出版社

作者：门明

页数：318

字数：269000

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

金融工程学是20世纪80年代末和90年代初在美国和英国等发达国家发展起来的一门新兴的金融学科。金融工程学的主要内容是研究金融衍生工具的定价规律、作用以及应用策略。

金融工程学将工程设计的思维引入金融领域，综合地运用概率分析。

金融工程学的发展极大地丰富了金融产品的范围，为不同投资者提供了适应其风险偏好的金融产品，从而大大地扩展了金融市场规模。

金融市场运行效率的提高直接促进了经济的增长。

本书的宗旨是使读者了解并掌握运用金融衍生工具（如期权、期货、远期合约和互换等）进行金融风险管理的原理、策略和技术。

本书的主要内容包括风险管理产品的发展，风险管理过程，风险管理市场，如何运用风险管理技术增加公司的价值，公司风险暴露衡量，远期合约风险管理策略，期货风险管理策略，互换风险管理策略，期权风险管理策略，新风险管理产品设计，杂交证券，以及金融工程案例等。

## 作者简介

门明博士 美国伊利诺言伊大学 (UIUC) MBA, 责任对外经济贸易大学副教授, 金融学系主任。作者多年来辛勤耕耘于金融衍生证券、金融工程学、国际投资和金融风险管理领域, 主持了数十项世界银行、联合国工发组织和国内外企业及政府部门的战略研究、投资并和风险管理研究项目。

先

## 书籍目录

第一章 金融风险管理的的发展 第一节 金融工程的概念 第二节 风险日增的世界金融市场 第三节 金融风险增大对公司的影响 第四节 预测者的失败 第五节 金融风险管理工具第二章 风险管理过程 第一节 风险管理产品概论 第二节 远期合约 第三节 期货合同 第四节 互换合同 第五节 期权合同 第六节 金融建筑模块第三章 风险管理市场 第一节 风云变幻的金融市场 第二节 金融衍生工具的迅猛发展 第三节 金融衍生工具的使用者 第四节 金融衍生工具经纪人第四章 风险管理对公司的增值作用 第一节 风险管理对公司价值的影响 第二节 Mdigliani-Millcr定理 第三节 风险管理可以减少公司赋税 第四节 风险管理可以减少交易成本 第五节 风险管理可以避免公司投资决策失误第五章 公司风险暴露的测定 第一节 公司的风险图像 第二节 公司财务报告所反映的金融价格风险 第三节 金融价格风险的内部度量 第四节 金融价格风险的外部度量第六章 远期合约风险管理策略 第一节 远期合约与表上套期保值策略的选择 第二节 远期合约市场 第三节 利率远期合约使用者第七章 期货风险管理策略 第一节 期货风险管理策略概述 第二节 运用期货进行套期保值 第三节 到期时间不匹配：基差风险 第四节 到期时间不匹配：条式套期保值和滚动套期保值 第五节 资产不匹配：跨品种套期保值 第六节 调整保证金帐户：“跟踪”套期保值 第七节 管理期货套期保值第八章 互换风险管理策略 第一节 运用互换减少融资成本 第二节 利用互换增加贷款能力.....第八章 互换风险管理策略第九章 期权风险管理策略第十章 期权定价模型解析第十一章 风险管理新产品设计第十二章 杂交证券第十三章 金融工程案例分析

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>