

金融工程



[金融工程_下载链接1](#)

著者:郑振龙, 陈蓉 编

出版者:高等教育出版社

出版时间:2012-6

装帧:

isbn:9787040353839

《普通高等教育"十一五"国家级规划教材·高等学校金融学专业主要课程教材:金融工程(第3版)》可分为五大部分:第一篇(第1章)全面介绍了金融工程的内涵、主要产品和金融工程的主要思想方法,提出金融工程就是一门关于金融产品设计、定价和风险管理的学科。第二篇到第四篇(第2—16章)分别介绍了远期、期货、互换和期权等主要金融衍生产品的市场结构与市场惯例、产品分析与定价、产品运用与交易策略等方面的内容;第五篇(第17章)先从风险识别、风险测度和风险管理三个角度介绍了现代金融风险管理的主要内容,然后重点介绍了VaR和信用风险。《普通高等教育"十一五"国家级规划教材·高等学校金融学专业主要课程教材:金融工程(第3版)》延续了前两版数学模型与金融学紧密融合的突出特点,保留了前两版的清晰写作脉络、知识点的前后一致性和呼应性、丰富的教学内容和大量的教学辅助资料,进一步强化深入浅出的讲解风格,让读者能修获得对金融工程、金融衍生产品和风险管理问题的感性认识,引导读者更好地将理论和知识运用到实践中去。

作者介绍:

郑振龙, 经济学博士, 金融工程教授, 博士生导师。现任厦门大学研究生院副院长、厦门大学王亚南研究院副院长、厦门大学证券研究中心常务副主任、中国金融学会常务理事兼学术委员、中国金融学会金融工程专业委员会常委、中国金融学年会第二届理事会主席、福建省金融学会副会长、《金融学(季刊)》主编。曾任亚太金融学会(Asia Pacific Finance)

Association) 理事。2002年入选教育部优秀青年教师资助计划。2004年入选教育部新世纪优秀人才支持计划。

陈蓉，博士，厦门大学副教授，美国康奈尔大学经济学博士后，东南融通系统工程有限公司博士后，曾在美国北卡罗来纳大学（夏洛特）数学与统计学系访问并任教。研究领域：金融工程、固定收益证券、结构性衍生产品与风险管理。在《经济学动态》、《统计研究》、《经济学家》、《国际金融研究》、《厦门大学学报（哲社版）》等期刊上发表10多篇论文，出版合著、合译、改编英文教材等共5部。主持6项金融产品设计、定价与风险管理方向的课题。曾任国内著名财经报纸《21世纪经济报道》和《国际金融报》特约撰稿人。

目录: 目录

第一章 金融工程概述

第一节 什么是金融工程

第二节 金融工程的发展历史与背景

第三节 金融工程的基本分析方法

本章小结

习题

第二章 远期与期货概述

第一节 远期与远期市场

第二节 期货与期货市场

第三节 远期与期货的比较

本章小结

习题

第三章 远期与期货定价

第一节 远期价格与期货价格

第二节 无收益资产远期合约的定价

第三节 支付已知现金收益资产远期合约的定价

第四节 支付已知收益率资产远期合约的定价

第五节 远期与期货价格的一般结论

第六节 远期（期货）价格与标的资产现货价格的关系

本章小结

习题

第四章 远期与期货的运用

第一节 运用远期与期货进行套期保值

第二节 运用远期与期货进行套利与投机

本章小结

习题

第五章 股指期货、外汇远期、利率远期与利率期货

第一节 股票指数期货

第二节 外汇远期

第三节 远期利率协议

第四节 利率期货

本章小结

习题

第六章 互换概述

第一节 互换的定义与种类

第二节 互换市场

本章小结

习题

第七章 互换的定价与风险分析

第一节 利率互换的定价

第二节 货币互换的定价

第三节互换的风险

本章小结

习题

第八章互换的运用

第一节运用互换进行套利

第二节运用互换进行风险管理

第三节运用互换构造新产品

本章小结

习题

第九章期权与期权市场

第一节期权的定义与种类

第二节期权市场

第三节期权交易机制

第四节期权与其他衍生产品的区别与联系

本章小结

习题

第十章期权的回报与价格分析

第一节期权的回报与盈亏分布

第二节期权价格的特性

本章小结

习题

附录内在价值与平价点

第十一章布莱克—舒尔斯—默顿期权定价模型

第一节布莱克—舒尔斯—默顿期权定价模型的基本思路

第二节股票价格的变化过程

第三节布莱克—舒尔斯—默顿期权定价公式

第四节B—S—M期权定价公式的精确度评价与拓展

本章小结

习题

附录布莱克—舒尔斯—默顿期权定价公式的推导

第十二章期权定价的数值方法

第一节二叉树期权定价模型

第二节蒙特卡罗模拟

第三节有限差分方法

本章小结

习题

第十三章期权的交易策略及其运用

第一节期权交易头寸及其运用

第二节期权交易策略及其运用

第三节期权组合盈亏图的算法

本章小结

习题

第十四章期权价格的敏感性和期权的套期保值

第一节Delta与期权的套期保值

第二节Theta与套期保值

第三节Gamma与套期保值

第四节Vega、rho与套期保值

第五节交易费用与套期保值

本章小结

习题

第十五章股票指数期权、外汇期权、期货期权与利率期权

第一节欧式股票指数期权、外汇期权和期货期权的定价

第二节标的资产支付连续红利的期权价格的敏感性

第三节利率期权

本章小结
习题
第十六章 奇异期权
第一节 常见的奇异期权
第二节 奇异期权的主要性质
本章小结
习题
第十七章 风险管理
第一节 风险与风险管理概述
第二节 在险值
第三节 信用风险管理
本章小结
习题
参考文献
· · · · · (收起)

[金融工程_下载链接1_](#)

标签

金融工程

金融

教材

中国

量化交易

衍生品

经管

金融学

评论

我只想说，陈蓉好！漂！酿！这可是素颜.....随便化个妆肯定漂亮的不行了。。。。。

又到了期末读教材的时候....

user friendly，建议先刷这本

能让我这脑袋看懂的书就是好书！！谢谢两位作者爸爸，我有空一定再看一遍！

数理知识实在太难了

拉高平均分，跪求上70T^T

一定要配上b站的视频一起看，没有随机过程基础的中间那几章可以不看，期权的价值总结的很到位

又到了期末读教材的时候.... @2015-06-21 10:56:24

[金融工程 下载链接1](#)

书评

