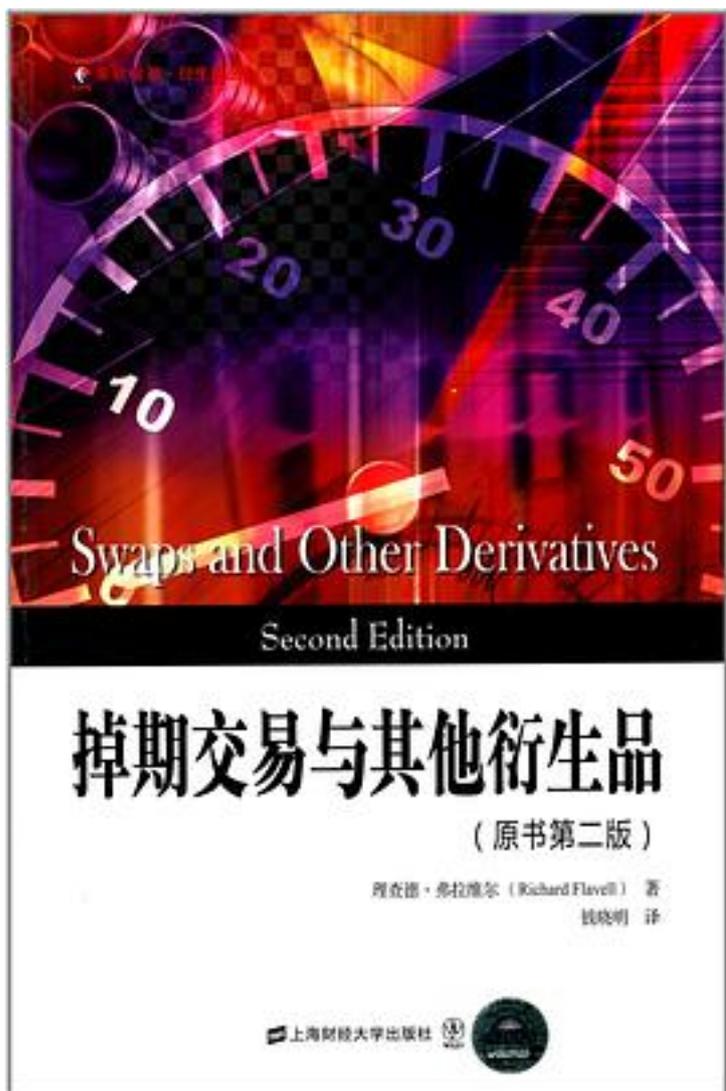


掉期交易与其他衍生品



[掉期交易与其他衍生品_下载链接1](#)

著者:理查德·弗拉维尔

出版者:上海财经大学出版社

出版时间:2014-2

装帧:平装

isbn:9787564218270

《掉期交易与其他衍生品（原书第二版）》详细讨论了如收益曲线、指数摊销、通胀链接、交叉市场、波动率、差额和数量调整型期权差额这些掉期和其他衍生品如何定价和套保。《掉期交易与其他衍生品（原书第二版）》还描述了如何建立利率曲线、从利率掉期曲线和交叉货币调整曲线中得出贴现因子的模型。

作者介绍:

理查德·弗拉维尔(Riehard Flavell)，作为金融工程师、顾问和培训师特别是在复杂衍生品和风险管理领域工作超过20年。他担任伦巴德风险机构(LombardRisk)的首席金融工程师 (Director of Financial Engineer—ing)长达7年时间，负责在不同定价和风险管理中模型的数学发展和实施。目前他担任卢茨达特公司(Lucidate)的董事长，这是一家给金融机构提供咨询和培训的专业公司。

目录: 总序前言作者简介常用术语缩写表

第1章掉期和其他金融衍生品1. 1介绍1. 2掉期的应用1. 3掉期市场概述1. 4掉期市场的发展1. 5结论

第2章短期利率掉期目标2. 1贴现、货币的时间价值及其他2. 2远期利率协议和利率期货2. 3短期掉期2. 4期货的凸偏倚2. 5掉期的远期定价

第3章通用的利率掉期目标3. 1通用利率掉期3. 2根据比较优势定价3. 3通用利率互换的相对定价3. 4债券市场与掉期市场的关系3. 5贴现函数3. 6构建混合曲线

第4章特定掉期的定价和估价目标4. 1简单特定掉期的定价：远期开始4. 2“过山车”4. 3简单特定掉期的定价：更复杂的例子4. 4作为贴现替代物的远期定价——重新讨论4. 5掉期估值

第5章资产包目标5. 1面值资产掉期的创建和定价5. 2平价到期资产掉期的创建和定价5. 3贴现、嵌入式贷款以及远期估价5. 4资产包的进一步拓展

第6章信用衍生工具背景和目标6. 1总收益掉期6. 2信用违约掉期6. 3通用信用违约掉期的定价和套期保值6. 4信用违约掉期模型的构建6. 5非通用信用违约掉期的定价和估值..

第7章更复杂的掉期第8章交叉市场与其他市场掉期第9章交叉货币掉期第10章柜台与交易期权第11章结构产品的掉期第12章传统市场风险管理第13章风险值

• • • • • [\(收起\)](#)

[掉期交易与其他衍生品_下载链接1](#)

标签

金融

衍生品

掉期

评论

[掉期交易与其他衍生品 下载链接1](#)

书评

[掉期交易与其他衍生品 下载链接1](#)