

赫尔版《期权、期货及其他衍生产品》导读



[赫尔版《期权、期货及其他衍生产品》导读 下载链接1](#)

著者:《赫尔版<期权、期货及其他衍生产品>导读》编写组

出版者:人民邮电出版社

出版时间:2018-2

装帧:

isbn:9787115478580

约翰·赫尔的《期权、期货及其他衍生产品》一书被誉为衍生产品投资圣经，是金融工程领域的权威用书。其体系全面，紧贴现实问题进行分析，这些特点使得该书成为全美商学院投资学课程首选教材，并且成为美国注册金融分析师（CFA）的指定参考书。

这本《赫尔版<期权、期货及其他衍生品>导读》由多位北京知名高校与科研院所主讲投资学课程的老师共同编写，旨在为大家系统萃取并解读《期权、期货及其他衍生产品》（第九版）一书的精华内容与思想。书中介绍了期货市场的运作机制、采用的期货对冲策略、远期及期货价格的确定、期权市场的运作过程、雇员股票期权的性质、期权交易策略以及信用衍生产品、布莱克斯科尔斯默顿模型、希腊值及其运用等内容。

本书适合所有高等院校财经专业的师生以及金融从业者、各级监管者阅读。

作者简介:

张扬，南开大学经济学学士、阿斯顿（英）商学院金融学硕士、中国社会科学院研究生院经济学博士、博士后。曾任中国社科院金融研究所副研究员，现任华控产业投资基金首席投资官、华龙航空公司董事长。

擅长跨国企业、大型集团公司、上市公司以及金融机构的投融资、并购整合及运营管理提升；致力于宏观经济、资本市场、公司发展战略以及公司核心竞争力建设等研究；在基金行业具有丰富的从业经验，长期从事包括股权投资基金、证券投资基金、对冲基金等领域的研究与实践工作。

张扬先生成功主持了上海宝信汽车集团（HK01293）、万达商业地产集团股份公司（HK03699）、万达电影院线股份有限公司（002739）、北京暴风科技股份有限公司（300431）、明日宇航股份有限公司（300159）、成都华气厚普机电设备股份有限公司（300471）、北京华龙商务航空有限公司等数十亿元的私募股权投资；曾负责辽宁路桥建设集团有限公司、中国第一拖拉机集团、云南红河光明股份公司（600239）、青岛宏达集团等近百亿资产规模的大型国有企业集团及上市公司的并购及重组。

张扬先生于2008年创建华控基金。华控基金是源于清华大学的专业私募股权投资平台，是致力于发现、投资并打造中国经济增长点中高成长细分龙头企业的专业私募股权投资机构。华控基金采用投资组合理念，依靠自身强大的行业研究体系、依托清华大学及由华控基金捐赠设立的私募股权研究院的优势资源、华控基金团队强大的投后管理能力，选择高成长细分的龙头企业进行投资，投资了一系列明星项目，迄今华控所有基金年化收益率超100%，给投资人带来了丰厚的回报，成为业内业绩表现最优异的私募股权投资机构。

张扬先生于2013年主导并购了华龙航空，进入商务航空领域。经过三年的整合、管理提升，目前华龙航空已成为国内第三大大公务机运营商。

目录: 第1章 引言1

1.1 内容概述1

1.2 应用与巩固2

第2章 期货市场的运作机制13

2.1 内容概述13

2.2 应用与巩固18

第3章 利用期货的对冲策略26

3.1 内容概述26

3.2 应用与巩固29

第4章 利率38

4.1 内容概述38

4.2 应用与巩固44

第5章 如何确定远期和期货价格55

5.1 内容概述55

5.2 应用与巩固59

第6章 利率期货68

6.1 内容概述68

6.2 应用与巩固70

第7章 互换79

7.1 内容概述79

7.2 应用与巩固83

第8章 证券化与2007年信用危机	93
8.1 内容概述	93
8.2 应用与巩固	93
第9章 OIS贴现、信用以及资金费用	97
9.1 内容概述	97
9.2 应用与巩固	98
第10章 期权市场机制	103
10.1 内容概述	103
10.2 应用与巩固	106
第11章 股票期权的性质	114
11.1 内容概述	114
11.2 应用与巩固	116
第12章 期权交易策略	126
12.1 内容概述	126
12.2 应用与巩固	133
第13章 二叉树	142
13.1 内容概述	142
13.2 应用与巩固	145
第14章 维纳过程和伊藤引理	156
14.1 内容概述	156
14.2 应用与巩固	159
第15章 布莱克-斯科尔斯-默顿模型	168
15.1 内容概述	168
15.2 应用与巩固	173
第16章 雇员股票期权	191
16.1 内容概述	191
16.2 应用与巩固	192
第17章 股指期货与货币期权	196
17.1 内容概述	196
17.2 应用与巩固	199
第18章 期货期权	209
18.1 内容概述	209
18.2 应用与巩固	212
第19章 希腊值	220
19.1 内容概述	220
19.2 应用与巩固	228
第20章 波动率微笑	244
20.1 内容概述	244
20.2 应用与巩固	247
第21章 基本数值方法	257
21.1 内容概述	257
21.2 应用与巩固	268
第22章 风险价值度	289
22.1 内容概述	289
22.2 应用与巩固	293
第23章 估计波动率与相关系数	300
23.1 内容概述	300
23.2 应用与巩固	305
第24章 信用风险	313
24.1 内容概述	313
24.2 应用与巩固	318
第25章 信用衍生产品	326
25.1 内容概述	326
25.2 应用与巩固	331

第26章 特种期权	340
26.1 内容概述	340
26.2 应用与巩固	343
第27章 再谈模型和数值算法	356
27.1 内容概述	356
27.2 应用与巩固	361
第28章 鞅与测度	374
28.1 内容概述	374
28.2 应用与巩固	380
第29章 利率衍生产品：标准市场模型	389
29.1 内容概述	389
29.2 应用与巩固	394
第30章 曲率、时间与Quanto调整	403
30.1 内容概述	403
30.2 应用与巩固	407
第31章 利率衍生产品：短期利率模型	415
31.1 内容概述	415
31.2 应用与巩固	423
第32章 HJM，LMM模型以及多种零息曲线	435
32.1 内容概述	435
32.2 应用与巩固	441
第33章 再谈互换	448
33.1 内容概述	448
33.2 应用与巩固	451
第34章 能源与商品衍生产品	455
34.1 内容概述	455
34.2 应用与巩固	457
第35章 实物期权	460
35.1 内容概述	460
35.2 应用与巩固	461
第36章 重大金融损失与借鉴	468
36.1 内容概述	468
36.2 应用与巩固	470
• • • • •	(收起)

[赫尔版《期权、期货及其他衍生产品》导读_下载链接1](#)

标签

衍生品

期货

期权

评论

[赫尔版《期权、期货及其他衍生产品》导读 下载链接1](#)

书评

[赫尔版《期权、期货及其他衍生产品》导读 下载链接1](#)