

金融工程



[金融工程_下载链接1](#)

著者:郑振龙//陈蓉

出版者:高等教育出版社

出版时间:2008-7

装帧:

isbn:9787040230239

《金融工程》分为三大部分：第一章从发展历史、分析方法的角度介绍金融工程的一般知识；第二至十六章分别介绍远期、期货、互换和期权等主要金融衍生产品的基础知识、市场制度、定价和运用，具体又可分为远期和期货(第二至五章)、互换(第六至八章)、期权(第九至十六章)三个部分；第十七章则对现代金融风险管理的基础知识进行了介绍。全书强调知识的应用性，注重理论模型的严谨性，配有大量丰富且贴近现实的案例解析。

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: 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 运用互换创造新产品 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 习题参考文献附表 标准正态分布累积概率函数表
.....
(收起)

[金融工程 下载链接1](#)

标签

金融工程

金融

教材

专业

经济学

经济

经济金融

数学

评论

我会干掉它！！

郑正龙的这本著作介于中级与高级之间，其中涉及到一些伊藤积分的内容是一般大学高等数学课程中不涉及的，因此要完全读懂需要自学一些数学。

才发现本书的好，案例很经典，适合入门学。

因为要去参加个培训同事特地给我找来了，翻了半天总觉得似曾相识却又说不出来，直到看到书上的一道习题恍然大悟：嗯，当年考试划的重点就是你，我把答案默写下来了……这原来是当年教科书……#论应试教育对我的影响

#悔恨的泪水流不停……定价这种坑爹事谁要做啦！

大学教科书，要重温补下几个基本知识点，地基打得不扎实~

通俗易懂吧。有点绕的地方作者都很清楚得解释了。虽然很多矫正。

马马虎虎，要是我自学肯定不行

T T

读完HULL和SHREVE的书，回头看看这本书，定位于本科的入门教材，在第一章里面就给出了很多比较深的例子，真是不好，不像外国的书循序渐进。
再读一遍，其实发现这本书不容易。

国内一流，部分抄袭Hull那本。。。

无套利定价。基差波动多头空头收益。互换风险和结清。欧式看涨期权看跌期权平价关系。伊藤引理伊藤过程。货币掉期定价。期权B-S-M定价模型。期货最小方差最优套期保值比率。。OMG蓝精灵！

弱弱标个已读吧。。。T-T

这个还是第二版的 第三版更正了很多东西 很多龙哥说是全世界绝无仅有最严谨的内容

噗。不知道这本书丢哪儿去了。

我见过最好的秀恩爱方式…就是我和你共同出一本教科书…哈哈郑老师和陈蓉真是虐狗

郑老师的课很爽，但是书写得不太易读啊orz

这本书案例很经典，讲解很通透，囊括内容很丰富，包括远期，期货，期权，互换等多种衍生工具，是一本不错的经济学读物

[金融工程_下载链接1](#)

书评

[金融工程_下载链接1](#)