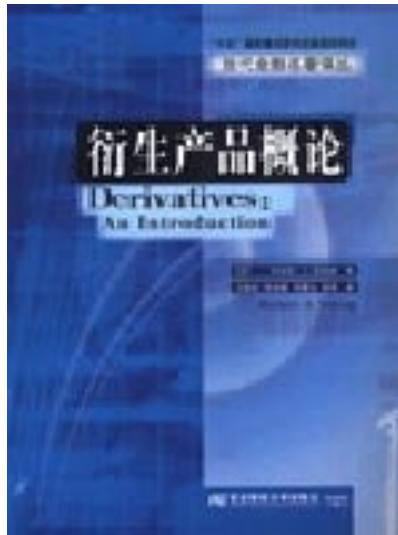


# 衍生产品概论



[衍生产品概论 下载链接1](#)

著者:罗伯特 · A.斯特朗

出版者:东北财经大学出版社

出版时间:2009-6

装帧:

isbn:9787811226966

《衍生产品概论(第2版)》对期权、期货、互换以及利率期权市场进行了详细的介绍，讲述了衍生产品定价的基本原理。《衍生产品概论(第2版)》最大特点是把理论和实践很好地结合起来，作者把从投机者和套期保值者那儿观察到的大量的应用实例包括在《衍生产品概论(第2版)》当中，这对深入理解金融衍生产品实践有着巨大裨益。同时设计了各种栏目，生动地说明了如何运用衍生产品去达到投机、获利或风险管理的目的。

《衍生产品概论(第2版)》是适用于金融学专业大学本科和研究生教育的极富价值的教材，对于经济管理类相关专业学生和社会各界读者，如果希望了解金融衍生产品的相关知识，《衍生产品概论(第2版)》也将提供非常有意义的帮助。

作者介绍:

罗伯特 · A.斯特朗是缅因州大学投资教育部的基金会教授以及缅因州大学金融学教授。

他在美国西点军事学校获得了工程学学士学位，在波士顿大学获得了工商管理硕士学位，在佩恩州大学获得了金融学博士学位。他同时也是缅因州海上高等学院以及哈佛大学的客座教授。1997—1999年曾任哈佛大学夏季经济学项目的副主管。他是持有特许注册证书的金融分析师。斯特朗博士的咨询业务集中在风险管理及资产评估上。向他咨询过的机构团体包括：东缅因州保健公司、班格尔水电公司、缅因州大众服务公司、大西洋能源公司、缅因州警察局、缅因州森林服务部等。他曾做过芝加哥期权交易所(CBOE)、芝加哥商品交易所(CBOT)以及美国证券交易所的协商会发言人。现今，他的研究方向主要集中在投资者资产分配上。从《金融期刊》与《证券组合管理期刊》到交易类期刊《投资与养老金》和《期货》都刊登过他的文章。他在2002年出版发行了他的第四本书《衍生产品概论》的第二版。斯特朗博士是东北经贸协会、班格尔扶轮社、波士顿证券分析师协会缅因州分会的前任主席，班格尔储蓄银行、班格尔储蓄银行基金、东缅因州慈善集团、James W.Sewall公司的董事会成员，班格尔证券公司及一家全业零售经纪公司的董事会主席。此外，他还是缅因州警察局荣誉上尉。

## 目录: 第1章 绪论

### 1. 1 序言

### 1. 2 衍生产品的种类

### 1. 3 衍生产品的参与者

### 1. 4 衍生产品的用途

### 1. 5 有效研究衍生产品

### 附录1A

## 第2章 股票期权的基本原理

### 2. 1 什么是期权，它们从何而来

### 2. 2 期权为何是一种好想法

### 2. 3 期权在哪里交易，如何交易

### 2. 4 期权费

### 2. 5 期权的收益与损失

## 第3章 基本期权策略：有抵补的看涨期权和有担保的看跌期权

### 3. 1 利用期权套期保值

### 3. 2 用期权获得收益

### 3. 3 稳定的股票头寸的损益图

### 3. 4 转好市况

## 第4章 期权组合与价差

### 4. 1 组合期权

### 4. 2 价差

### 4. 3 非标准价差

### 4. 4 其他策略

### 4. 5 保证金要求

### 4. 6 评价价差

## 第5章 期权的定价

### 5. 1 期权定价的简要历史

### 5. 2 套利与期权定价

### 5. 3 直观布莱克—斯科尔斯模型

## 第6章 布莱克—斯科尔斯期权定价模型

### 6. 1 布莱克—斯科尔斯期权定价模型

### 6. 2 用历史数据计算布莱克—斯科尔斯价格

### 6. 3 隐含波动率

### 6. 4 用布莱克—斯科尔斯模型解看跌期权期权费

## 第7章 期权的希腊字母

### 7. 1 主要的期权定价导数

### 7. 2 其他导数

### 7. 3 德尔塔中性

- 7. 4 两个市场：走向与震荡
- 7. 5 动态套期保值

## 第8章 期货市场的基本原理

- 8. 1 期货合约的概念
- 8. 2 市场的技术性细节
- 8. 3 市场参与者
- 8. 4 清算过程
- 8. 5 期货合约定价的基本原理
- 8. 6 商品期货价差

## 第9章 股票指数期货

- 9. 1 股票指数及其期货合约
- 9. 2 股票指数期货的用途
- 9. 3 用股票指数期货套期保值

## 第10章 外汇期货

- 10. 1 外汇风险
- 10. 2 远期汇率
- 10. 3 外汇期货
- 10. 4 风险的处理

## 第11章 利率期货的基本原理

- 11. 1 利率期货
- 11. 2 短期国债、欧洲美元及其期货合约
- 11. 3 用欧洲美元期货套期保值
- 11. 4 长期国债及其期货合约
- 11. 5 利率期货合约的定价
- 11. 6 用利率期货获得价差

## 第12章 期货合约与投资组合管理

- 12. 1 风险免疫的概念
- 12. 2 用期货改变资产配置

## 第13章 互换和利率期权

- 13. 1 利率互换
- 13. 2 外币互换
- 13. 3 交叉互换
- 13. 4 利率期权

## 第14章 互换定价

- 14. 1 直观互换定价
- 14. 2 确定互换价格
- 14. 3 离市互换定价
- 14. 4 互换的套期保值
- 14. 5 货币互换定价

## 第15章 其他衍生资产

- 15. 1 期货期权
- 15. 2 期货期权的定价
- 15. 3 认股权证
- 15. 4 其他衍生资产

## 第16章 金融工程和风险管理

- 16. 1 金融工程
- 16. 2 风险管理

## 第17章 当代问题研究

- 17. 1 长期资本管理公司
- 17. 2 风险值
- 17. 3 新产品的开发
- 17. 4 程序交易
- 17. 5 财务会计准则133号(FAS 133)

## 术语表

· · · · · (收起)

## [衍生产品概论 下载链接1](#)

### 标签

金融

教材

### 评论

重点推荐阅读期货的交易清算过程（第八章）

---

## [衍生产品概论 下载链接1](#)

### 书评

对金融衍生品的阐述非常系统，从期权、期货、互换三个大项目入手，一下子让读者有了框架似的思维。一开始学财务管理的时候，就是看到注会教材里乱七八糟而有模模糊略的叙述，虽然这样的内容组织目的是为了扩展学生的知识面但是由于对整个知识框架没有介绍，只是把一些细小的知...

---

## [衍生产品概论 下载链接1](#)