

# 金融衍生产品保值与套利技术



[金融衍生产品保值与套利技术\\_下载链接1](#)

著者:吴可

出版者:清华大学出版社

出版时间:2011-3

装帧:

isbn:9787302249689

《金融衍生产品保值与套利技术》在比较系统、完整地介绍金融工程基本理论和基本方法的基础上，突出金融工程课程教学的逻辑主线，增强教材的可读性，使学生能够比较

迅速、准确地把握金融工程学课程的核心内容和学科边缘。《金融衍生产品保值与套利技术》共分15章。第1~11章介绍了远期、期货、期权以及互换等衍生工具的基本概念及性质和市场保值、套利与投机的操作原理及方式。对每一种衍生工具都按照套期保值、套利与投机三个层面的原理及方法作了较为详尽的阐述。第12~15章讲授难度较大的衍生产品定价原理与求解方法。《金融衍生产品保值与套利技术》从结构安排上，凸显了“先基本概念，再市场操作，后理论定价”的教学逻辑主线以及由浅入深、重在应用的编写特点。为便于学习和掌握，每章前附有章前导读、重点及难点提示、关键词；章末列示了该章节的内容小结以及配套习题。

《金融衍生产品保值与套利技术》是面向普通高等院校经济、金融类专业的本科学生使用的金融工程学课程的基础教材，也可供其他非经济类本科学生及研究生选修学习使用。

作者介绍:

目录: 第一章 导论
第一节 金融衍生产品概述
第二节 金融衍生产品与金融工程、金融创新
第三节 金融衍生产品定价与结构化分析技术
第四节 金融衍生产品的市场运作方式
第五节 金融衍生产品发展概述
本章小结
思考与练习
第二章 远期交易保值与套利技术
第一节 远期合约的基本概念及形成发展
第二节 远期市场
第三节 远期交易报价
第四节 远期交易保值与套利技术
第五节 远期组合——掉期交易技术
本章小结
思考与练习
第三章 期货交易原理与运作方式
第一节 期货市场
第二节 期货交易的的市场运作
第三节 期货市场套期保值策略
第四节 期货市场套期图利策略
第五节 期货市场投机交易策略
本章小结
思考与练习
第四章 利率期货保值与套利技术
第一节 利率期货市场概述
第二节 利率期货合约
第三节 利率期货合约报价方式
第四节 利率期货应用
本章小结
思考与练习
第五章 股指期货保值与套利技术
第一节 股指期货市场概述
第二节 股指期货标的——股票指数
第三节 股指期货合约要项与市场规则
第四节 股指期货保值与套利应用
本章小结

思考与练习

第六章 外汇期货保值与套利技术

第七章 期权交易基本原理与操作方式

第八章 期权价值构成及其边界分析

第九章 期权组合保值套利策略

第十章 金融互换保值与套利技术

第十一章 结构化衍生产品价值分析

第十二章 衍生产品合成定价技术概述

第十三章 远期与期货定价技术

第十四章 期权定价B-S方程与求解

第十五章 互换的定价与求解

• • • • •

(收起)

[金融衍生产品保值与套利技术\\_下载链接1\\_](#)

标签

金融

期权

投资

金融技术

算法交易

算法

期货

教材

评论

可做為一本各市場金融產品速查手冊。

-----  
《金融衍生产品保值与套利技术》，这本书逻辑极其混乱还错误百出，不知道怎么让清华大学出版社过审的。书确实够厚，也讲了很多东西，远期、期货、期权、互换的案例和计算列举了不少，但语言生涩，内容反复，数据错误乃家常便饭。最重要的一点根本没有灌输金融工程的内在思想，无风险套利都没能讲明白。

-----  
[金融衍生产品保值与套利技术\\_下载链接1](#)

## 书评

-----  
[金融衍生产品保值与套利技术\\_下载链接1](#)