

《现代金融工程》

图书基本信息

书名：《现代金融工程》

13位ISBN编号：9787504924322

10位ISBN编号：7504924326

出版时间：2001-01

出版社：中国金融出版社

作者：孙金龙 / 史永东

页数：445

版权说明：本站所提供下载的PDF图书仅提供预览和简介以及在线试读，请支持正版图书。

更多资源请访问：www.tushu000.com

《现代金融工程》

内容概要

本书在对金融工程概念和理论系统介绍的基础上，详细阐述了各种金融工具创新，并通过案例分析，介绍了金融工具的操作及新的金融产品的开发，对21世纪金融工程在我国的发展做了探讨。

书籍目录

1. 金融工程简介
- 1.1 金融工程概念辨析
- 1.2 金融工程与金融创新
- 1.3 金融工程与风险管理
- 1.4 金融工程与金融分析
- 1.5 发达国家近年来的金融创新产品
2. 金融工程产生与发展的动因
- 2.1 外部环境因素
- 2.2 银行企业内部环境因素
3. 远期
- 3.1 概述
- 3.2 远期利率协议
- 3.3 综合远期外汇协议 (SAFE)
4. 金融期货
- 4.1 金融期货概述
- 4.2 利率期货
- 4.3 货币期货
- 4.4 债券期货
- 4.5 股票指数期货
5. 互换
- 5.1 互换市场
- 5.2 利率互换与货币互换
- 5.3 互换的基本应用
6. 期权
- 6.1 概述
- 6.2 股票期权
- 6.3 利率期权
- 6.4 外币期权
- 6.5 互换期权
- 6.6 期货期权
- 6.7 复合期权
- 6.8 特异期权
7. 资产证券化
- 7.1 资产证券化概述
- 7.2 资产证券化的运作
- 7.3 住宅抵押贷款证券化
- 7.4 其他贷款证券化
8. 均值、方差分析理论
- 8.1 均值、方差分析的思考方法
- 8.2 资产组合理论
- 8.3 资本资产定价模型 (CAPM)
- 8.4 指数模型
- 8.5 套利定价理论 (APT)
- 8.6 投资组合绩效测定方法
9. 远期类合约定价理论
- 9.1 理论的某些准备
- 9.2 远期合约定价理论

- 9.3 远期汇率和远期利率的定价
 - 9.4 期货定价理论
 - 9.5 互换定价理论
 - 10. 期权定价理论
 - 10.1 期权定价理论准备
 - 10.2 期权价格的边界条件
 - 10.3 布莱克-科尔斯 (Black-Scholes) 模型
 - 10.4 二项式期权定价模型
 - 10.5 默顿 (Merton) 红利模型和约尔 (Roll) 红利模型
 - 10.6 股票指数期权、货币期权和期货期权的定价
 - 11. 金融产品开发技术
 - 11.1 金融产品开发概述
 - 11.2 金融产品开发的基本技术
 - 12. 资产负债管理技术
 - 12.1 早期的资产负债管理技术
 - 12.2 现代资产负债管理
 - 12.3 利率敏感性缺口管理
 - 13. 资产重组与杠杆收购技术
 - 13.1 资产重组的概念、分类及其发展
 - 13.2 资产重组的方法
 - 13.3 杠杆收购技术
 - 14. 利率风险管理技术
 - 14.1 运用远期利率协议管理利率风险
 - 14.2 利用利率期货进行利率风险管理
 - 14.3 利用利率互换管理利率风险
 - 14.4 利用期权管理利率风险
 - 15. 汇率风险管理技术
 - 15.1 运用远期管理汇率风险
 - 15.2 运用外汇期货管理汇率风险
 - 15.3 运用货币互换管理汇率风险
 - 15.4 运用期权管理汇率风险
 - 16. 股权风险管理技术
 - 16.1 证券组合管理
 - 16.2 利用股指期货管理股权风险
 - 16.3 利用期权管理股权风险
 - 17. 金融工程在中国的发展与前景
 - 17.1 发展金融工程的必要性
 - 17.2 发展金融工程的可能性
 - 17.3 尚需解决的问题及发展思路
- 后记

版权说明

本站所提供下载的PDF图书仅提供预览和简介，请支持正版图书。

更多资源请访问：www.tushu000.com