

# 《金融工程——运用衍生工具管理风险！

## 图书基本信息

书名：《金融工程——运用衍生工具管理风险（第三版）》

13位ISBN编号：9787307125242

出版时间：2016-1-1

作者：洛伦兹·格利茨

页数：705

译者：彭红枫

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](http://www.tushu000.com)

# 《金融工程——运用衍生工具管理风险！

## 内容概要

《金融工程:运用衍生工具管理风险(第三版)》全面深入介绍了现实世界几乎所有种类的金融产品，详细阐述了如何运用这些创新的金融产品管理各种金融风险的方法。不管你是经验丰富的对冲基金经理还是刚刚进入金融市场的新手，所有你需要掌握的如何最小化金融风险的方法以及如何将理论运用于实践的技巧，在这本百科全书式的《金融工程》中都有全面系统的介绍。

## 书籍目录

作者简介

致谢

出版商致谢

第二版前言

第三版前言

第一部分工具

1导论

1.1近40年金融工程发展史

1.2什么是金融工程？

1.3风险属性

1.4金融工程和风险

1.5本书结构

2现货市场

2.1金融市场概述

2.2外汇市场

2.3货币市场

2.4债券市场

2.5股权市场

2.6商品市场

2.7现货工具与衍生工具

2.8资本充足率要求

3远期汇率与远期利率

3.1远期汇率

3.2远期利率

3.3远期利率能否预测未来即期利率？

3.4即期与远期利率实务

4远期利率协议

4.1远期利率协议简介

4.2远期利率协议定义

4.3远期利率协议术语

4.4交割过程

4.5利用远期利率协议对冲

4.6远期利率协议定价

4.7远期利率的比较静态分析

5金融期货

5.1期货市场发展简史

5.2金融期货简介

5.3期货交易——从人工交易到电子交易

5.4期货的买方和卖方

5.5结算机制

5.6期货保证金

5.7实物交割与现金结算

5.8期货与现货市场的比较

5.9期货的优点

6短期利率期货

6.1定义

6.2短期利率期货合同约定价

- 6.3基差
- 6.4现货与期货价格的收敛性
- 6.5期货价格的比较静态分析
- 6.6对冲实例
- 6.7短期期货合约对比
- 6.8期货与远期利率协议的比较
- 6.9价差头寸
- 7国债和股指期货
- 7.1国债期货定义
- 7.2最便宜交割债券
- 7.3基于现货持有法的国债期货定价
- 7.4隐含回购利率
- 7.5交割机制
- 7.6利用国债期货对冲
- 7.7股指和股指期货
- 7.8股指期货合约定义
- 7.9股指期货优点
- 7.10基于现货持有法的股指期货定价
- 7.11股指期货实务
- 7.12货币市场和股指期货市场投资策略
- 8互换
- 8.1利率互换和跨币种货币互换
- 8.2互换市场的发展
- 8.3利率互换
- 8.4非标准利率互换
- 8.5隔夜指数互换
- 8.6跨币种货币互换
- 8.7互换应用
- 8.8资产互换
- 8.9固定期限互换和固定期限国债互换
- 8.10通货膨胀互换
- 8.11股权和股息互换
- 8.12商品互换
- 8.13波动性和方差互换
- 8.14奇异互换
- 8.15国际掉期及衍生品协会文本
- 8.16信用危机后衍生品市场的变化
- .....
- 9互换定价
- 10期权——基础知识与定价
- 11期权——波动性及相关的希腊字母
- 12期权——从积木分析法到构建投资组合
- 13期权——利率及奇异期权
- 14信用衍生品简介
- 15信用违约互换的定价及信用指数
- 第二部分应用
- 16金融工程的应用
- 17管理货币风险
- 18运用远期利率协议、期货和互换管理利率风险

# 《金融工程——运用衍生工具管理风险！

19运用期权及期权类工具管理利率风险

20股权风险管理

21商品风险管理

22信用风险管理

23结构化品

索引

# 《金融工程——运用衍生工具管理风险！

## 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](http://www.tushu000.com)