

《金融工程》

图书基本信息

书名：《金融工程》

13位ISBN编号：9787302030034

10位ISBN编号：7302030030

出版时间：1998-06

出版社：清华大学出版社

作者：马歇尔(美),等

页数：451

译者：宋逢明/等

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

书籍目录

目录

第一篇 金融工程概述

第一章 金融工程简介

概述

金融工程的范围

金融工程的工具

金融工程与金融分析

金融工程的适用范围

金融工程工作组

解决方案的产品化

金融工程师的就职机会

本书的计划

小结

第二章 促使金融工程发展的因素

概述

环境因素

企业内部因素

近20年来的创新产品

小结

第三章 金融工程师的知识基础

概述

理论

数学和统计学的技能

建模技巧

产品知识

有关的技术知识

会计、税收和法律

美国金融工程师协会

小结

第二篇 金融工程师的概念性工具

第四章 估值关系与应用

概述

现金流

时间价值

时间价值的敏感性分析

应用

工作表软件

复利计息

绝对估值和相对估值

小结

第五章 收益的度量

概述

效用

度量收益：利润和收益率

收益率 税前值与税后值

收益率和复利

投资的注资期 (investmenthorizons)

小结

附录5.1对数正态分布，相对收益率和持有期收益率

第六章 风险：投资组合的考虑、投资的注资期、杠杆

概述

波动性：价格风险的来源

以百分比形式表示价格风险

投资组合分析中的数学问题

风险厌恶与投资组合分析

投资注资期（时间维）的作用

无风险资产

多头和空头头寸以及杠杆的作用

小结

第七章 有关风险度量的进一步讨论

概述

价格风险的度量

小结

第八章 利率和汇率

概述

债务型金融工具的基本概念

汇率：基本理论

相对收益率曲线

小结

第九章 投机、套利和市场的效率

概述

正在运行的市场机制

投机

套利

有效率的的市场：是朋友还是敌人

小结

第十章 公司财务主管的看法：读懂字里行间隐含的意思

概述

为什么要进行风险管理

策略风险暴露的辨识

金融工程所能发挥的巨大作用

分析资产负债表

为企业的风险暴露建模

第三篇 金融工程师的实体性工具

第十一章 产品开发

概述

金融产品的定义

第十二章 期货和远期

概述

期货

远期

远期利率协议（FRA）

远期利率协议和互惠掉换

小结

附录12.1欧洲货币利差期货和远期汇率协议

第十三章 互惠掉换

概述

互惠掉换产品的发展史

有关利率的一些习惯的注释

互惠掉换的结构

利率互换

货币互换

商品互换

互惠掉换的变形

互惠掉换交易商的作用

小结

第十四章 单期期权：买权和卖权

概述

买权和卖权：基本概念

损益状态图

利用期权作套期保值

现金结算的期权

小结

第十五章 多期期权：顶、底、套、顶权、掉换期权和复式期权

概述

利率顶（顶）

利率底（底）

利率套（套）

杂型利率期权

货币化隐含期权

复式期权

小结

第十六章 固定收入证券

概述

一级市场和二级市场

美国国债现货市场

公司债和优先股的现货市场

浮动利率工具

按揭贷款的现货市场

国际债券市场

小结

附录16.1 银行折现率与等效债券收益率的换算

附录16.2 等效债券收益率的另一形式

第十七章 近期债券市场的创新

概述

零息票债券

零息票收益曲线

多级按揭贷款和其它资产担保的有价证券

契约终止

回购/反向回购市场

垃圾债券

存架登记

浮动股息率优先股和反向浮动利率债券

小结

附录17.1 零息票债券的税收

第十八章 权益及与权益有关的金融工具

概述

美国的所有者权益的形式

与权益有关的证券

权益的销售

权益在公司资本结构中的作用

小结

第十九章 混合证券

概述

混合证券的类型

投资者的动机

发行者的动机

小结

第四篇 金融工程手段和策略

第二十章 资产/负债管理

概述

资产/负债管理的演变

基础概念

流动性管理的变化

利息回报率的管理（利率敏感性缺口的作用）

投资银行家在资产/负债管理中的作用

小结

第二十一章 套期保值和有关的风险管理技术

概述

套头比及其应用

套期保值理论的新改进

套期保值的成本

套期保值的模块化方法

风险管理的其它问题和工具

小结

第二十二章 公司重组和杠杆赎买（LBO）

概述

公司重组

私人化：杠杆赎买

一个典型的杠杆赎买的案例

投资银行在杠杆赎买中的作用：金融工程师的工作

小结

第二十三章 套利和复合金融工具

概述

套利：从古代到现代

复合证券

复合衍生工具

现货和期货（Cash - and - Carry）的复合

套利中的现货和期货复合：增加证券组合的收益

创造复合长期债券

用互惠掉换组合头寸

复合双重货币债券

复合的和真实的证券在质量上的区别

小结

附录23.1全部计提在内的总成本

第二十四章 税收驱动的交易

概述

防止敌意接管

企业的重新资本化

非盈利性：不相关业务收入的税收

满足短期融资的要求

债券掉换

自清偿优先股

白马王子在何方

再谈判债务

不动产转让的税收和成本

不动产的税收

小结

第二十五章 各种基于权益的策略

概述

股利夺取策略

全市场投资

资产配置

证券组合保险

程序化交易

股票的松绑分解

小结

附录25.1股票指数的计算

第五篇 金融工程的未来前景

第二十六章 未来趋势：全球化和科学技术

概述

全球化的含义

金融全球化近期发展的简述

新市场和市场联系的发展

近来在结算和清算方面的进步

全球化、金融工程和货币政策

工作表软件和建模：微型计算机的作用

走向一个新的世界

小结

附录26.1金融服务业的全球化

第二十七章 创新金融产品和服务的法律保护

引言和概述

利用版权保护金融产品

利用专利保护金融产品

利用反不正当竞争法保护有价证券

利用商标或服务标志保护有价证券

小结

《金融工程》

编辑推荐

金融工程是现代金融学的最新发展，标志着金融科学走向产品化和工程化。《金融工程》是一部系统、全面介绍这一新兴学科的名著。作者约翰·马歇尔（John F. Marshall）是国际金融工程师协会执行主席，金融工程学科的创始人之一。

精彩短评

- 1、翻译太差了....
- 2、这本书其实感觉编得挺乱的，也没怎么看~~不过这门课挺有趣的~~而且我们那老师也是三年来唯一觉得特别好的一个老师~~
- 3、经典书籍，买来一读，略有收获
- 4、这个版本的，很经典的，宋先生很专业的，自己也写过一本金融工程的，看过很多不懂的。毕竟是搞金融的数学哪有我这么烂的呢》
- 5、金融工程
- 6、学着学着财管又把这本书想起来了。。。看来那个C+也不完全是被坑了
- 7、Hull的那本书根本就不是金融工程的全貌，这本书更加全面，虽然不够具体
- 8、一般了，对金融工程的介绍
- 9、金工书籍
- 10、2014-09-16
- 11、有点乱~
- 12、各种产品，棒！可惜数学部分还需要仔细学习
- 13、好几年前看过的了，说了一些基础的内容

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