《金融工程学原理》

图书基本信息

书名：《金融工程学原理》

13位ISBN编号：978730019348X

出版时间：2014-6

作者：萨利赫·N·内夫特奇

页数：625

译者：王忠玉,董竹,董奕

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.tushu111.com

《金融工程学原理》

内容概要

随着国外和国内金融工程专业本科生、研究生教育的发展，关于金融工程学方面的著作和教材不断涌现，其中最广为流行并被国外众多大学所采用的一本书就是萨利赫·内夫特奇教授的《金融工程学原理》。《金融工程学原理》（第二版）的内容几乎涵盖金融工程学所研究的方方面面，从金融工程的初级基本原理开始阐述，既有金融市场的惯例、远期合约和现金流工程、利率衍生品工程、互换工程、回购工程、期权工程等，又有金融工程定价工具、基本定理及其应用、静态复制合成衍生品的策略等。在高级内容中，既包括动态复制方法、凸性头寸工程、波动性工程、波动性微笑以及波动性交易，又包括信用违约互换工程、结构化产品工程、信用指数及其份额、违约相关性的定价及交易、本金保护技术、股权工具工程化等。从研究方法论的角度来看，内容讲解既有现金流图示法和合约方程相结合的直观方法，又有金融工程阐述与实际应用紧密结合的手法，同时注重引入金融工程的最新发展。本书既可作为大学本科生、研究生的金融工程学的入门教材，又可用作金融市场从业者和有关人员的参考书。

《金融工程学原理》

作者简介

萨利赫·N·内夫特奇教授（1947—2009），是金融市场与金融工程领域首屈一指的著名学者。他是纽约市社会研究新学院的全球金融项目主任，同时还任职于瑞士FAME项目、雷丁大学ISMA中心和香港科技大学。他在明尼苏达大学获得博士学位，曾任教于乔治华盛顿大学和纽约市立大学研究生院。他还曾是许多国际金融机构、银行和政府部门的顾问。内夫特奇教授同时在数理金融领域是一位活跃且高产的学者，他以使用清晰而通俗易懂的方法著称。

《金融工程学原理》

书籍目录

第1章 导论
1. 独特的金融工具
2. 货币市场问题
3. 税收例子
4. 贯穿本书的主线
5. 交易波动性
6. 结论
阅读建议
案例研究：日本贷款和远期
第2章 概念和定义
1. 引论
2. 市场
3. 参与者
4. 交易机制
5. 市场惯例
6. 金融工具
7. 头寸
8. 辛迪加过程
9. 结论
阅读建议
附录2—1 对冲基金行业
习题
第 3章 现金流工程与远期合约
1. 引论
2. 什么是合成
3. 远期合约
4. 货币远期合约
5. 合成和定价
6. 合约方程
7. 应用
8. “ 更好的 ” 合成
9?期货
10. 远期合约惯例
11. 结论
阅读建议
习题
案例研究：1998年HKMA和对冲基金
第 4章 简单利率衍生工具工程
1. 引论
2. Libor和其他基准利率
3. 远期贷款
4. 远期利率协议
5. 期货：欧洲货币合约
6. 现实世界的复杂性
7. 远期利率与期限结构
8. 惯例
9. 题外话：剥离品

10. 结论
阅读建议
习题
第 5章 互换工程引论
1. 互换的逻辑方法
2. 应用
3. 工具：互换
4. 互换类型
5. 利率互换工程
6. 互换的使用
7. 新发行证券的互换机制
8. 相关惯例
9. 货币互换与外汇互换
10. 新增术语
11. 结论
阅读建议
习题
第 6章 金融工程中的回购市场策略
1. 引论
2. 什么是回购
3. 回购的类型
4. 权益回购
5. 回购市场策略
6. 利用回购的合成
7. 结论
阅读建议
习题
案例研究：最便宜交割债券和回购套利
第 7章 动态复制方法与合成
1. 引论
2. 例子
3. 静态复制回顾
4. “特定”合成
5. 动态复制原理
6. 某些重要条件
7. 现实生活的复杂性
8. 结论
阅读建议
习题
第 8章 期权交易机制
1. 引论
2. 什么是期权
3. 期权的定义与符号
4. 作为波动性工具的期权
5. 期权的各种工具
6. 希腊字母和应用
7. 现实生活的复杂性
8. 结论：什么是期权
阅读建议

附录 8—1
附录8—2
习题
第 9章 凸性头寸工程
1. 引论
2. 谜题
3. 债券凸性交易
4. 凸性的来源
5. 特殊工具：跨货币
6. 结论
阅读建议
习题
案例研究：长期债券的凸性、互换和套利
第 10章 期权工程及其应用
1. 引论
2. 期权交易策略
3. 基于波动性的交易策略
4. 奇异期权
5. 报价惯例
6. 现实世界的复杂性
7. 结论
阅读建议
习题
第 11章 金融工程定价工具
1. 引论
2. 定价方法概要
3. 框架
4. 应用
5. 基本定理的意义
6. 无套利的动态特性
7. 选择何种定价方法
8. 结论
阅读建议
附录11—1 基本定理的简单经济学
习题
第 12章 基本定理的某些应用
1. 引论
2. 应用1：蒙特卡洛方法
3. 应用2：校准
4. 应用3：跨货币
5. 结论
阅读建议
习题
第 13章 固定收益工程
1. 引论
2. 互换的框架
3. 期限结构建模
4. 动态期限结构
5. 测度变换技术

6. 应用
7. 后置支付互换与凸性
8. 交叉货币互换
9. 差额（跨货币）互换
10. 结论
阅读建议
附录13—1 实际中的收益率曲线计算
习题
第 14章 波动性工程、波动性互换和波动性交易工具
1. 引论
2. 波动性头寸
3. 波动性收益的不变性
4. 纯波动性头寸
5. 波动性互换
6. 合约的某些应用
7. 何种波动性？
8. 结论
阅读建议
习题
第 15章 作为资产类的波动性与微笑
1. 引论：作为资产类的波动性
2. 作为融资工具的波动性
3. 微笑
4. 狄拉克delta函数
5. 在期权收益中的应用
6. 布里登利曾伯格简化
7. gamma收益的期权价格特征
8 . 笑引论
9. 准备知识
10. 微笑初议
11. 什么是波动性微笑
12. ?微笑的动态特性
13. ? 如何解释微笑
14. ?微笑的相关事宜
15. ?微笑的交易
16. ?微笑的定价
17. ?奇异期权与微笑
18. ?结论
阅读建议
习题
第 16章 信用市场：信用违约互换工程
1. 引论
2. 术语和定义
3. 信用违约互换
4. 现实世界的复杂性
5. 信用违约互换分析
6. 违约概率算法
7. 结构化信用产品
8. 总收益互换

9. 结论
阅读建议
习题
案例研究：信用联结票据
第 17章 结构化产品工程初步
1. 引论
2. 结构化产品的目的
3. 结构化固定收益产品
4. 某些原型产品
5. 结论
阅读建议
习题
第 18章 信用指数及其份额
1. 引论
2. 信用指数
3. 资产支持证券和担保债务凭证引论
4. 信用指数的建立
5. 指数套利
6. 份额：标准和定制
7. 份额：建模和定价
8. 滚动及其含义
9. 信用与违约损失分布
10. 重要的推广
11. 新指数市场
12. 结论
阅读建议
附录18—1 信用指数的历史
习题
第 19章 违约相关性定价与交易
1. 引论
2. 有关历史
3. 两个简单例子
4. 模型
5. 违约相关性与交易
6. delta对冲与相关性交易
7. 现实世界的复杂性
8. 结论
阅读建议
附录19—1 某些基础统计概念
习题
案例研究：2005年5月的波动事件
第 20章 本金保护技术
1. 引论
2. 经典案例
3. 固定比例投资组合保险概述
4. 固定比例投资组合保险的动态建模
5. 应用：固定比例投资组合保险和权益份额
6. 变形：动态比例投资组合保险
7. 现实世界的复杂性

8. 结论
阅读建议
习题
第 21章 利率上限/下限及互换期权在抵押贷款中的应用
1. 引论
2. 抵押贷款市场
3. 互换期权
4. 互换期权定价
5. 抵押贷款支持证券
6. 利率上限协议与下限协议
7. 结论
阅读建议
习题
案例研究：丹麦抵押贷款债券
第 22章 权益工具工程化：定价与复制
1. 引论
2. 什么是权益
3. 权益产品工程化
4. 证券化金融工程
5. 结论
阅读建议
习题
案例研究：波动性交易
参考文献
译后记

《金融工程学原理》

精彩短评

1、终于出新版了，可惜作者去世了

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.tushu111.com