

《衍生工具与风险管理》

图书基本信息

书名：《衍生工具与风险管理》

13位ISBN编号：9787111484738

出版时间：2015-1

作者：唐·钱斯,罗伯特·布鲁克斯

页数：557

译者：丁志杰,谢蓉蓉,郭凯

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

《衍生工具与风险管理》

内容概要

《金融教材译丛:衍生工具与风险管理(原书第9版)》作者唐·钱斯和罗伯特·布鲁克斯都是美国研究金融衍生产品和风险管理的一流教授。全书不但详细介绍了基于金融资产的衍生品以及从事衍生品交易的机构和市场、衍生品定价方法和定价策略等,还有有机地把所有知识点都尽可能地运用于实践,强调了理论在真实情况下的实践运用。

书籍目录

前言

第1章 导言

1.1 衍生品市场和工具

1.2 标的资产

1.3 金融衍生品市场的重要概念

概念、应用和拓展（1）

1.4 现货市场与衍生品市场的基本联系

1.5 衍生品市场的作用

概念、应用和拓展（2）

1.6 对衍生品市场的批评

1.7 衍生品市场的误区

1.8 衍生品与道德

1.9 衍生品和你的职业生涯

1.10 衍生品信息来源

1.11 本书概述

小结

关键术语

拓展阅读

概念回顾

习题

第一部分 期权

第2章 期权市场结构

2.1 期权市场的发展

2.2 看涨期权

2.3 看跌期权

2.4 场外期权市场

2.5 场内期权交易

2.6 交易机制

2.7 期权报价

概念、应用和拓展（1）

2.8 期权类型

2.9 期权交易费用

2.10 期权市场监管

概念、应用和拓展（2）

小结

关键术语

拓展阅读

概念回顾

习题

附录2A 保证金要求

习题

附录2B 期权交易税收

习题

第3章 期权定价原理

3.1 基本符号和术语

3.2 看涨期权的定价原理

概念、应用和拓展（1）

3.3看跌期权定价原理

概念、应用和拓展（2）

小结

关键术语

拓展阅读

概念回顾

习题

附录3A观察期权边界条件的动态变化

第4章期权定价模型：二叉树模型

4.1单期二叉树模型

4.2两期二叉树模型

概念、应用和拓展（1）

4.3二叉树模型的扩展

概念、应用和拓展（2）

软件应用4.1

小结

关键术语

拓展阅读

概念检测

习题

第5章期权定价模型：布莱克—斯科尔斯—默顿模型

5.1布莱克—斯科尔斯—默顿模型

5.2作为二叉树期权定价模型极限的布莱克—斯科尔斯—默顿模型

概念、应用和拓展（1）

5.3布莱克—斯科尔斯—默顿模型的假设

5.4一个诺贝尔奖公式

软件应用5.1

5.5布莱克—斯科尔斯—默顿公式中的变量

5.6当股票支付股息时的布莱克—斯科尔斯—默顿模型

5.7布莱克—斯科尔斯—默顿模型以及对美式看涨期权的深入研究

5.8波动率的估计

软件应用5.2

概念、应用和拓展（2）

5.9看跌期权定价模型

5.10期权风险管理

5.11当布莱克—斯科尔斯—默顿期权模型不一定成立时

小结

关键术语

拓展阅读

概念检测

习题

附录5A隐含波动率的简便计算

第6章期权基本策略

6.1术语和符号

6.2股票交易

6.3看涨期权交易

6.4看跌期权交易

6.5看涨期权与股票：有保障的

看涨期权

概念、应用和拓展（1）

6.6看跌期权与股票：保护性看跌期权

概念、应用和拓展（2）

6.7合成看跌期权和看涨期权

软件演示6.1用Excel电子表Stratlyz9e.xls分析期权策略

小结

关键术语

拓展阅读

概念回顾

习题

第7章高级期权交易策略

7.1价差期权：基本概念

7.2货币价差期权

概念、应用和拓展（1）

概念、应用和拓展（2）

7.3日历价差期权

7.4比率价差期权

7.5跨式期权

7.6盒式价差期权

小结

关键术语

拓展阅读

概念回顾

习题

第二部分远期、期货和互换

第8章远期、期货市场的结构

8.1远期、期货市场的发展

8.2柜台远期市场

8.3有组织的期货交易

8.4期货交易者

8.5期货交易的机制

概念、应用和拓展（1）

8.6期货报价

概念、应用和拓展（2）

8.7期货合约的种类

8.8远期与期货交易的交易成本

8.9场外清算中心

小结

关键术语

拓展阅读

概念回顾

习题

附录8A美国期货交易的课税

习题

第9章远期、期货以及期权定价原理

9.1一般资产持有套利

概念、应用和拓展

9.2基于现金流的持有套利

9.3模型定价和风险溢价

9.4 期货期权定价

小结

关键术语

拓展阅读

概念回顾

习题

第10章 期货套利策略

10.1 短期利率期货套利

10.2 中长期利率期货套利

软件操作10.1

10.3 股指期货套利

10.4 外汇期货套利

概念、应用和拓展

小结

关键术语

拓展阅读

概念回顾

习题

附录10 ACBOT长期国债转换因子的计算

软件操作10.1

第11章 远期、期货套期保值、价差与目标策略

11.1 套期保值的原因

11.2 套期保值的概念

11.3 套期保值比率的确定

11.4 套期保值策略

概念、应用和拓展

11.5 价差策略

11.6 目标策略

小结

关键术语

拓展阅读

概念回顾

习题

附录11A

第12章 互换

12.1 利率互换

概念、应用和拓展(1)

概念、应用和拓展(2)

12.2 货币互换

概念、应用和拓展(3)

12.3 股权互换

12.4 有关互换的一些结语

小结一

关键术语

拓展阅读

概念检测

习题

第三部分 高级衍生工具

第13章 利率远期和期权

13.1远期利率协议

13.2利率期权

概念、应用和拓展

13.3利率互换期权及远期互换

小结

关键术语

拓展阅读

概念回顾

习题

第14章高级衍生品及投资策略

14.1高级权益衍生品及投资策略

概念、应用和拓展（1）

14.2高级利率衍生品

14.3奇异期权

概念、应用和拓展（2）

14.4一些不常见的衍生品

小结

关键术语

拓展阅读

概念回顾

习题

附录14A蒙特卡罗模拟

第15章金融风险管理技术与应用

15.1为什么要进行风险管理

15.2市场风险管理

15.3信用风险管理

概念、应用和拓展（1）

概念、应用和拓展（2）

15.4其他类型的风险

15.5透视金融风险管理

小结

关键术语

拓展阅读

概念回顾

习题

第16章组织中的风险管理

16.1风险管理行业的结构

概念、应用和拓展

16.2公司风险管理职能的执行

16.3风险管理会计方法

16.4避免衍生品交易损失

16.5风险管理的行业标准

16.6高层管理者的责任

小结

关键术语

拓展阅读

概念回顾

习题

附录A公式

附录B参考文献
附录C概念总结
术语表
符号列表

《衍生工具与风险管理》

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