

《衍生工内定价理论》

图书基本信息

书名：《衍生工内定价理论》

13位ISBN编号：9787505815452

10位ISBN编号：7505815458

出版时间：1998-10

出版社：经济科学出版社

作者：王文灵,等

页数：272

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

《衍生工内定价理论》

内容概要

衍生工具定价理论，ISBN：9787505815452，作者：王文灵，于瑾编著

书籍目录

目录

第一篇 衍生工具总论

第1章 衍生工具概论

- 1.1 衍生工具的定义及特点
- 1.2 衍生工具的分类
- 1.3 衍生工具的作用
- 1.4 衍生工具的发展动因
- 1.5 衍生工具的发展对金融业的影响
- 1.6 衍生工具的发展趋势

第2章 期货

- 2.1 期货合约的基本内容
- 2.2 期货交易市场的组成及交易机制
- 2.3 主要期货品种

第3章 期权

- 3.1 期权的基本概念和构成要素
- 3.2 期权的分类
- 3.3 期权交易的主要品种

第4章 互换

- 4.1 互换概述
- 4.2 互换交易的主要类型
- 4.3 互换基本结构分析

第二篇 期货定价理论与应用

第5章 期货价格与即期价格的关系分析

- 5.1 期货的持有成本关系式的推导
- 5.2 期货的持有成本构成分析
- 5.3 期货价格的期限结构分析
- 5.4 远期合约和期货合约的差别比较

第6章 期货合约套期保值原理的回归分析

- 6.1 期货的一般套期保值原理
- 6.2 套期保值的基差风险分析
- 6.3 交叉套期
- 6.4 最佳套头比率的推导
- 6.5 最佳套头比率的回归分析

第7章 均衡期货价格模型分析

- 7.1 期货市场中投机的风险与收益分析
- 7.2 无偏预期与投机风险
- 7.3 期货合约的资本资产定价理论
- 7.4 均衡期货价格模型

第三篇 期权定价理论与应用

第8章 期权价格区间的界定

- 8.1 期权的相关概念及其利润的表示法
- 8.2 期权价格变动区间的界定
- 8.3 建立界定期权价格下限的套利基础分析模型
- 8.4 美式期权提前执行的条件分析
- 8.5 看涨 看跌期权平价关系
- 8.6 建立期权平价关系的套利基础分析模型
- 8.7 股票期权的平价关系

8.8商品期权与期货期权的价格关系

第9章 期权定价理论

9.1期权定价的三种分析方法

9.2商品价格与收益的分布假定

9.3欧式看涨期权的风险中立定价

9.4欧式看跌期权的风险中立定价

9.5影响期权价格的因素分析

9.6Black-Scholes期权定价模型

第10章 期权交易策略

10.1相关假设

10.2六种基本头寸的利润函数

10.3无风险套利策略

10.4复合头寸交易策略

10.5n个期权与商品头寸交易策略

10.6价差交易策略

第四篇 互换定价理论与应用

第11章 利率互换的价格结构分析

11.1利率互换参考价格表

11.2对参考价格的调整分析

11.3市场非均衡状态下的互换价格调整

11.4利率互换的变异形式

第12章 货币互换的价格结构分析

12.1货币互换的现金流

12.2货币互换的定价分析

12.3不涉及本金交换的货币互换定价

12.4货币互换场外定价的调整分析

12.5货币互换的变异形式

第13章 商品互换与股权互换的价格结构分析

13.1概述

13.2商品互换的基本结构

13.3股权互换的基本结构

13.4股权互换交易商

13.5基本股权互换的变异形式

第14章 互换定价理论

14.1短期利率互换定价理论分析

14.2长期利率互换定价理论分析

第五篇 衍生工具风险管理

第15章 衍生工具的风险分析

15.1即期风险

15.2远期风险

15.3期权风险

第16章 衍生工具的市场风险管理

16.1市场风险管理方法概述

16.2单一分析法

16.3综合分析法

第17章 衍生工具的信用风险管理

17.1信用风险对衍生工具定价的影响

17.2衍生工具信用风险的防范

附录 常数d从 - 4.99到 + 4.99范围内的

单位正态分布概率表
参考文献

《衍生工内定价理论》

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