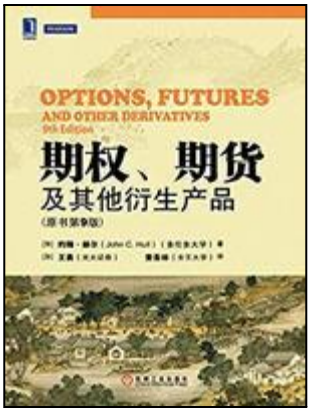
《期权、期货及其他衍生品》





分类	经济类 / 金融
作者	(加)John Hull / 约翰·赫尔 
英文书名	《Options, Futures and Other Derivatives》
出版年份	2009(第7版 原著) 2009(第7版 简体中译本) 2011(第8版 原著) 2012(第8版 简体中译本) 2014(第9版 原著) 2014(第9版 简体中译本) 2017(第10版 原著) 2018(第10版 简体中译本)

简介

作者是国际公认的金融衍生品权威，先后执教于约克大学、纽约大学、伦敦商学院、多伦多大学，曾任 Bonharm 金融中心主任。

此书是其代表作，在西方金融界广泛流传，被誉为【华尔街的圣经】。如今已出到第10版。
书中全面系统地讲解了衍生品定价与金融风险管理的基本理论和方法。

中文目录(第7版)

推荐序一
推荐序二
译者序
作者简介
译者简介

前言
第1章 导言
第2章 期货市场的运作机制
第3章 利用期货的对冲策略
第4章 利率
第5章 远期和期货价格的确定
第6章 利率期货
第7章 互换
第8章 期权市场的运作过程
第9章 股票期权的性质
第10章 期权交易策略
第11章 二叉树简介
第12章 维纳过程和伊藤引理
第13章 布莱克斯科尔斯默顿模型
第14章 雇员股票期权
第15章 股指期权与货币期权
第16章 期货期权
第17章 希腊值
第18章 波动率微笑
第19章 基本数值方法
第20章 风险价值度
第21章 估计波动率和相关系数
第22章 信用风险
第23章 信用衍生产品
第24章 特种期权
第25章 气候、能源以及保险衍生产品
第26章 再论模型和数值算法
第27章 鞅与测度
第28章 利率衍生产品——标准市场模型
第29章 曲率、时间与 Quanto 调整
第30章 利率衍生产品——短期利率模型
第31章 利率衍生产品——HJM 与 LMM 模型
第32章 再谈互换
第33章 实物期权

第34章 重大金融损失以及借鉴意义

术语表
附录A DerivaGem软件说明
附录B 世界上的主要期权期货交易所
附录C x≤0 时 N(x) 的取值
附录D x≥0 时 N(x) 的取值

【编程随想】收藏的电子书清单
【编程随想】的博客