



◎〈各章参考书目〉

※〈各章参考书目〉

第一章 《期货市场的产生和发展》参考文献

- Chance, D. An Introduction to Options and Futures. Orlando, FL: Dryden Press, 1989.
- Chicago Board of Trade. Commodity Trading Manual. Chicago, 1989.
- Duffie, D. Futures Markets. Englewood Cliffs, NJ: Prentice Hall, 1989.
- Hicks, J. R. Value and Capital. Oxford: Clarendon Press, 1939.
- Horn, F. F Trading in Commodity Futures. New York: New York Institute of Finance, 1984.
- Keynes, J. M. A Treatise on Money. London: Macmillan, 1930.
- Kolb, R. Understanding Futures Markets. Glenview, IL: Schneeweis. Financial Futures. Homewood, IL: Richard D. Irwin 1986.
- Teweles, R. J. , and F. J. Jones. The Futures Game. New York: McGraw-Hill, 1987.

第二章 《期货市场的基本功能和作用》参考文献

- On empirical research concerning forward and futures prices
- Cornell, B. , and M. Reinganum. "Forward and Futures Prices: Evidence from Foreign Exchange Markets," Journal of Finance 36 (December 1981): 1035~1045.
- French, K. "A Comparison of Futures and Forward Prices," Journal of Financial Economic (November 1983): 311~342
- Park, H. Y., and A. H. Chen. "Differences Between Futures and Forward Prices: A Further Investigation of Marking-to-Market Effects," Journal of Futures Markets 5 (February 1985):77~88.
- Rendleman, R., and C. Carabini. "The Efficiency of the Treasury Bill Futures Markets," Journal of Finance 34(September 1979): 895~914.
- viswanath, P. V. "Taxes and the Futures-Forward Price Difference in the 91-Day T-Bill Market" Journal of Money, Credit, and Banking 21, no. 2 (May 1989): 190~205.
- On empirical research concerning the relationship between futures prices and expected future spot prices.
- Chang, E. C. "Returns to Speculators and the Theory of Normal Backwardation," Journal of Finance 40 (March 1985): 193~208.

第三章 《期货市场的组织结构》参考文献

- Dusak, K. "Futures Trading and Investor Returns: An Investigation of Commodity Risk Premiums," Journal of Political Economy 81 (December 1973): 1387~1406.
- Gray, R. W. " The Search for a Risk Premium," Journal of Political Economy 69 (June 1961): 250~260.

Houthakker, H. S. "Can Speculators Forecast Prices?" *Review of Economics and Statistics* (1957):

143~151.

Telser, L. G. "Futures Trading and the Storage of Cotton and Wheat," *Journal of Political Economy* 66 (June 1958): 233~255.

On the theoretical relationship between forward and futures prices

Cox, J. C., J. E. Ingersoll, and S. A. Ross. "The Relation between Financial Economics 9 (December 1981): 321~346.

Jarrow, R. A., and G. S. Oldfield. "Forward Contracts and Futures Contracts," *Journal of Financial Economics* 9 (December 1981): 373~382.

Kane, E. J. "Market Incompleteness and Divergences between Forward and Futures Interest Rates," *Journal of Finance* 35 (May 1980): 221~234.

Margrabe, W. "A Theory of Forward and Futures Prices," Working paper, The Wharton School University of Pennsylvania, 1976.

Richard, S., and M. Sundaresan. "A Continuous-Time Model of Forward and Futures Prices in a Multigood Economy," *Journal of Financial Economics* 9 (December 1981): 347~372.

Hicks, J. R. *Value and Capital*. Oxford University Press, 1939.

Keynes, J. M. *Treatise on Money*. London: Macmillan, 1930.

第四章 《期货交易流程》参考文献

Bhattacharya, M. "Transaction Data Tests of Efficiency of the Chicago Board Options Exchange," *Journal of Financial Economics* 12 (1983): 161~185.

Galai, D. "Empirical Test of Boundary Conditions for CBOE Options," *Journal of Financial Economics* 6 (1978): 187~211.

Gould, J. P., and D. Galai. "Transactions Costs and the Relationship between Put and Call Prices," *Journal of Financial Economics* 1 (1974): 105~129.

Klemkosky, R. C., and B. G. Resnick. "An Ex-Ante Analysis of Put-Call Parity," *Journal of Financial Economics* 8 (1980): 363~378.

Klemkosky, R. C., and B. G. Resnick. "Put-Call Parity and Market Efficiency," *Journal of Finance* 34 (December 1979): 1141~1155.

Merton, R. C. "The Relationship between Put and Call Prices: Comment," *Journal of Finance* 28 (March 1973): 183~184.

Merton, R. C. "Theory of Rational Option Pricing," *Bell Journal Of Economics and Management Science* 4 (Spring 1973):141~183.

Stoll, H. R. "The Relationship between Put and Call Option Prices," *Journal of Finance* 31 (May 1969): 319~332.

第五章 《套期保值》参考文献

Chicago Board of Trade. *Introduction to Hedging*. Chicago, 1984.

Ederington, L. H. "The Hedging Performance of the New Futures Market," *Journal of Finance* 34 (March 1979): 157~170.

Franckle, C. T. "The Hedging Performance of the New Futures Market: Comment," *Journal of Finance* 35 (December 1980): 1273~1279.

Johnson, L. L. "The Theory of Hedging and Speculation in Commodity Futures Markets," *Review of Economics Studies* 27 (October 1960):139~151.

McCade, G. M., and C. T. Franckle. "The Effectiveness of Rolling the Hedge Forward in the Treasury

Bill Futures Market,” *Financial Management* 12 (Summer 1983): 21~29.

Miller, M., and C. Culp. “Risk Management Lessons from Metallgesellschaft,” *Journal of Applied Corporate Finance* (Fall 1994).

Nikkhah, S. “How End Users Can Hedge Fuel Costs in Energy Markets,” *Futures* (October 1987): 66~67.

Stulz, R. M. “Optimal Hedging Policies,” *Journal of Financial and Quantitative Analysis* 19 (June 1984): 127~140

第六章 《投机与套利》参考文献

Allen, S. L., and A. D. Kleinstein. *Valuing Fixed-Income Investments and Derivative Securitized*. New York: New York Institute of Finance, 1991.

Chicago Board of Trade. *Interest Rate Futures for Institutional Investors*. Chicago, 1987.

Fabozzi, F. J. *Fixed-Income Mathematics: Analytical and Statistical Techniques* Chicago: Probus, 1993.

Figlewski, S. *Hedging With Financial Futures for Institutional Investors*. Cambridge, MA: Ballinger, 1986.

Gay, G. D., R. W. Kolb, and R. Chiang. “Interest Rate Hedging: An Empirical Test of Alternative Strategies,” *Journal of Financial Research* 6 (Fall 1983): 187~197.

第七章 《期货定价》参考文献

Klemkosky, R. C., and D. J. Lasser. “An Efficiency Analysis of the T-Bond Futures Market,” *Journal of Futures Markets* 5 (1985)L 607~620.

Kolb, R. W., and R. Chiang. “Improving Hedging Performance Using Interest Rate Futures,” *Financial Management* 10 (Fall 1981) : 72~79.

Resnick, B. G. “The Relationship between Futures Prices for U. S. Treasury Bonds,” *Review of Research in Futures Markets* 3 (1984): 88~104.

Resnick, B. G., and E. Hennigar. “The Relationship between Futures and Cash Prices for U. S. Treasury Bonds,” *Review of Research in Futures Markets* 2 (1983): 282~299.

Senchak, A. J., and J. C. Easterwood. “Cross Hedging CDs with Treasury Bill Futures,” *Journal of Futures Markets* 3 (1983): 429~438.

Veit, W. T., and W. W. Reiff. “Commercial Banks and Interest Rate Futures: A Hedging Survey,” *Journal of Futures Markets* 3 (1983): 283~293.

第八章 《期货市场价格分析》参考文献

1、[美]约翰·赫尔. 期权、期货和衍生证券导论[M]. (张陶伟译), 中国人民大学出版社, 2001.

2、[美]约翰·马歇尔, 维普尔·班塞尔. 金融工程[M]. (宋逢明等译), 清华大学出版社, 1998.

3、[英]洛伦兹·格利茨. 金融工程学[M]. (唐旭等译), 经济科学出版社, 1998.

4、宋逢明. 金融工程原理—无套利均衡分析[M]. 清华大学出版社, 1999.

5、郑振龙. 金融工程[M]. 高等教育出版社, 2003.

6、郑明川, 王胜强. 期货交易理论和实物[M]. 浙江大学出版社, 2002.

7、范龙振, 胡畏. 金融工程学[M]. 上海人民出版社, 2003.

8、田源等主编. 期货交易全书. 北京: 中国大百科全书出版社, 1993

9、W. 格罗期斯曼, 常清. 期货市场的理论政策与管理. 济南, 山东人民出版社, 1992

10、杨玉川等. 现代期货市场学. 北京: 经济管理出版社, 1993

11、李一智. 期货与期权教程(第2版). 北京, 清华大学出版社, 2003

12、郑超文. 技术分析详解. 上海: 复旦大学出版社, 1993

13、陶非等. 中国期货市场理论问题研究. 北京: 中国财政经济出版社, 1997

14、童赠银. 国际金融产品交易技术. 中国金融出版社, 1998年版。

- 15、王健. 期货市场理论与实务. 对外经济贸易大学出版社, 1996年版。
- 16、施兵超. 金融期货与期权. 上海三联书店, 1996年版。

第九章 《金融期货》参考文献

- 1、[美]约翰. 赫尔. 期权、期货和衍生证券导论[M]. (张陶伟译), 中国人民大学出版社, 2001。
- 2、[美]约翰. 马歇尔, 维普尔. 班塞尔. 金融工程[M]. (宋逢明等译), 清华大学出版社, 1998。
- 3、[英]洛伦兹. 格利茨. 金融工程学[M]. (唐旭等译), 经济科学出版社, 1998。
- 4、宋逢明. 金融工程原理—无套利均衡分析[M]. 清华大学出版社, 1999。
- 5、郑振龙. 金融工程[M]. 高等教育出版社, 2003。
- 6、郑明川, 王胜强. 期货交易理论和实物[M]. 浙江大学出版社, 2002。
- 7、陈世炬, 高材林等. 金融工程学原理[M]. 中国金融出版社, 2000。
- 8、范龙振, 胡畏. 金融工程学[M]. 上海人民出版社, 2003。
- 9、[美]查尔斯. W. 史密森. 管理金融风险— 衍生产品、金融工程、价值最大化管理[M]. (第三版), 中国人民大学出版社, 2003。
- 10、陈松男. 金融工程学[M]. 复旦大学出版社, 2002。
- 11、W. 格罗期斯曼, 常清. 期货市场的理论政策与管理. 济南, 山东人民出版社, 1992
- 12、杨玉川等. 现代期货市场学. 北京: 经济管理出版社, 1993
- 13、李一智. 期货与期权教程 (第2版). 北京, 清华大学出版社, 2003
- 14、叶永刚. 金融工程案例与评析. 武汉大学出版社2000年版。
- 15、[美]基思. 卡思伯森. 金融工程— 衍生品与风险管理. (张陶伟彭永江译). 中国人民大学出版社, 2004。
- 16、门明著. 金融工程学. 对外经济贸易大学出版社2000年版。

第十章 《期权市场概述》参考文献

- 1、[美]约翰. 赫尔. 期权、期货和衍生证券导论[M]. (张陶伟译), 中国人民大学出版社, 2001。
- 2、[美]约翰. 马歇尔, 维普尔. 班塞尔. 金融工程[M]. (宋逢明等译), 清华大学出版社, 1998。
- 3、[英]洛伦兹. 格利茨. 金融工程学[M]. (唐旭等译), 经济科学出版社, 1998。
- 4、郑振龙. 金融工程[M]. 高等教育出版社, 2003。
- 5、陈世炬, 高材林等. 金融工程学原理[M]. 中国金融出版社, 2000。
- 6、范龙振, 胡畏. 金融工程学[M]. 上海人民出版社, 2003。
- 7、[美]马克. 格林布莱特, 史瑞丹. 蒂特曼. 金融市场与公司战略[M]. 中国人民大学出版社, 2003。
- 8、[美]查尔斯. W. 史密森. 管理金融风险— 衍生产品、金融工程、价值最大化管理[M]. (第三版), 中国人民大学出版社, 2003。
- 9、陈松男. 金融工程学[M]. 复旦大学出版社, 2002。
- 10、陈燕文、梁保祥. 金融案例分析. 中国审计出版社1999年版。
- 11、叶永刚. 金融工程案例与评析. 武汉大学出版社2000年版。
- 12、童赠银. 国际金融产品交易技术. 中国金融出版社, 1998年版。
- 13、[美]基思. 卡思伯森. 金融工程— 衍生品与风险管理. (张陶伟彭永江译). 中国人民大学出版社, 2004。
- 14、宋逢明著. 金融工程原理: 无套利均衡分析. 清华大学出版社1999年版。
- 15、李一智. 期货与期权教程 (第2版). 北京, 清华大学出版社, 2003
- 16、门明著. 金融工程学. 对外经济贸易大学出版社2000年版。

第十一章 《期权套利策略》参考文献

- 1、[美]约翰·赫尔. 期权、期货和衍生证券导论[M]. (张陶伟译), 中国人民大学出版社, 2001。
- 2、[美]约翰·马歇尔, 维普尔·班塞尔. 金融工程[M]. (宋逢明等译), 清华大学出版社, 1998。
- 3、[英]洛伦兹·格利茨. 金融工程学[M]. (唐旭等译), 经济科学出版社, 1998。
- 4、宋逢明. 金融工程原理—无套利均衡分析[M]. 清华大学出版社, 1999。
- 5、郑振龙. 金融工程[M]. 高等教育出版社, 2003。
- 6、郑明川, 王胜强. 期货交易理论和实物[M]. 浙江大学出版社, 2002。
- 7、陈世炬, 高材林等. 金融工程学原理[M]. 中国金融出版社, 2000。
- 8、范龙振, 胡畏. 金融工程学[M]. 上海人民出版社, 2003。
- 9、[美]马克·格林布莱特, 史瑞丹·蒂特曼. 金融市场与公司战略[M]. 中国人民大学出版社, 2003。
- 10、[美]查尔斯·W. 史密森. 管理金融风险— 衍生产品、金融工程、价值最大化管理[M]. (第三版), 中国人民大学出版社, 2003。
- 11、陈松男. 金融工程学[M]. 复旦大学出版社, 2002。
- 12、李一智, 侯晓鸿. 套期保期数量风险与控制. 中国证券与期货, No. 5, 1998
- 13、叶永刚. 金融工程案例与评析. 武汉大学出版社2000年版。
- 14、宋逢明著. 金融工程原理: 无套利均衡分析. 清华大学出版社1999年版。
- 15、[美]基思·卡思伯森. 金融工程— 衍生品与风险管理. (张陶伟彭永江译). 中国人民大学出版社, 2004。
- 16、门明著. 金融工程学. 对外经济贸易大学出版社2000年版。

第十二章 《合成策略》参考文献

- 1、[美]约翰·赫尔. 期权、期货和衍生证券导论[M]. (张陶伟译), 中国人民大学出版社, 2001。
- 2、[美]约翰·马歇尔, 维普尔·班塞尔. 金融工程[M]. (宋逢明等译), 清华大学出版社, 1998。
- 3、[英]洛伦兹·格利茨. 金融工程学[M]. (唐旭等译), 经济科学出版社, 1998。
- 4、宋逢明. 金融工程原理—无套利均衡分析[M]. 清华大学出版社, 1999。
- 5、郑振龙. 金融工程[M]. 高等教育出版社, 2003。
- 6、陈世炬, 高材林等. 金融工程学原理[M]. 中国金融出版社, 2000。
- 7、范龙振, 胡畏. 金融工程学[M]. 上海人民出版社, 2003。
- 8、[美]马克·格林布莱特, 史瑞丹·蒂特曼. 金融市场与公司战略[M]. 中国人民大学出版社, 2003。
- 9、[美]查尔斯·W. 史密森. 管理金融风险— 衍生产品、金融工程、价值最大化管理[M]. (第三版), 中国人民大学出版社, 2003。
- 10、陈松男. 金融工程学[M]. 复旦大学出版社, 2002。
- 11、陈湛匀. 创新金融工具. 立信会计出版社, 1994年版。
- 12、宋逢明著. 金融工程原理: 无套利均衡分析. 清华大学出版社1999年版。
- 13、门明著. 金融工程学. 对外经济贸易大学出版社2000年版。
- 14、李一智. 期货与期权教程 (第2版). 北京, 清华大学出版社, 2003

第十三章 《期权价格的范围》参考文献

- 1、[美]约翰·赫尔. 期权、期货和衍生证券导论[M]. (张陶伟译), 中国人民大学出版社, 2001。
- 2、[美]约翰·马歇尔, 维普尔·班塞尔. 金融工程[M]. (宋逢明等译), 清华大学出版社, 1998。
- 3、[英]洛伦兹·格利茨. 金融工程学[M]. (唐旭等译), 经济科学出版社, 1998。
- 4、郑振龙. 金融工程[M]. 高等教育出版社, 2003。
- 5、陈世炬, 高材林等. 金融工程学原理[M]. 中国金融出版社, 2000。
- 6、范龙振, 胡畏. 金融工程学[M]. 上海人民出版社, 2003。

- 7、[美]马克·格林布莱特，史瑞丹·蒂特曼. 金融市场与公司战略[M]. 中国人民大学出版社，2003。
- 8、[美]查尔斯.W. 史密森. 管理金融风险— 衍生产品、金融工程、价值最大化管理[M]. (第三版)，中国人民大学出版社，2003。
- 9、陈松男. 金融工程学[M]. 复旦大学出版社，2002。
- 10、宋逢明著. 金融工程原理：无套利均衡分析. 清华大学出版社1999年版。
- 11、张华编著. 金融衍生工具及其风险管理. 立信会计出版社1999年版。
- 12、李一智. 期货与期权教程（第2版）. 北京，清华大学出版社，2003
- 13、施兵超著. 金融期货与期权. 上海三联书店1996年版。
- 14、门明著. 金融工程学. 对外经济贸易大学出版社2000年版。
- 15、[美]基思·卡思伯森. 金融工程— 衍生品与风险管理. (张陶伟彭永江译). 中国人民大学出版社，2004。

第十四章 《期权定价模型》参考文献

- 1、[美]约翰·赫尔. 期权、期货和衍生证券导论[M]. (张陶伟译)，中国人民大学出版社，2001。
- 2、[美]约翰·马歇尔，维普尔·班塞尔. 金融工程[M]. (宋逢明等译)，清华大学出版社，1998。
- 3、[英]洛伦兹·格利茨. 金融工程学[M]. (唐旭等译)，经济科学出版社，1998。
- 4、宋逢明. 金融工程原理— 无套利均衡分析[M]. 清华大学出版社，1999。
- 5、郑振龙. 金融工程[M]. 高等教育出版社，2003。
- 6、陈世炬，高材林等. 金融工程学原理[M]. 中国金融出版社，2000。
- 7、范龙振，胡畏. 金融工程学[M]. 上海人民出版社，2003。
- 8、[美]马克·格林布莱特，史瑞丹·蒂特曼. 金融市场与公司战略[M]. 中国人民大学出版社，2003。
- 9、[美]查尔斯.W. 史密森. 管理金融风险— 衍生产品、金融工程、价值最大化管理[M]. (第三版)，中国人民大学出版社，2003。
- 10、陈松男. 金融工程学[M]. 复旦大学出版社，2002。
- 11、宋逢明著. 金融工程原理：无套利均衡分析. 清华大学出版社1999年版。
- 12、张华编著. 金融衍生工具及其风险管理. 立信会计出版社1999年版。
- 13、[美]基思·卡思伯森. 金融工程— 衍生品与风险管理. (张陶伟彭永江译). 中国人民大学出版社，2004。
- 14、门明著. 金融工程学. 对外经济贸易大学出版社2000年版。

第十五章 《互换》参考文献

- 1、[美]约翰·赫尔. 期权、期货和衍生证券导论[M]. (张陶伟译)，中国人民大学出版社，2001。
- 2、[美]约翰·马歇尔，维普尔·班塞尔. 金融工程[M]. (宋逢明等译)，清华大学出版社，1998。
- 3、[英]洛伦兹·格利茨. 金融工程学[M]. (唐旭等译)，经济科学出版社，1998。
- 4、郑振龙. 金融工程[M]. 高等教育出版社，2003。
- 5、陈世炬，高材林等. 金融工程学原理[M]. 中国金融出版社，2000。
- 6、范龙振，胡畏. 金融工程学[M]. 上海人民出版社，2003。
- 7、[美]马克·格林布莱特，史瑞丹·蒂特曼. 金融市场与公司战略[M]. 中国人民大学出版社，2003。
- 8、陈松男. 金融工程学[M]. 复旦大学出版社，2002。
- 9、田国立主编. 金融互换交易指南. 中国社会科学出版社，1995年版。
- 10、陈湛匀. 创新金融工具. 立信会计出版社，1994年版。
- 11、王爱俭主编. 金融创新与风险管理. 中国金融出版社，1996年版。
- 12、宋逢明著. 金融工程原理：无套利均衡分析. 清华大学出版社1999年版。
- 13、张华编著. 金融衍生工具及其风险管理. 立信会计出版社1999年版。

14、门明著. 金融工程学. 对外经济贸易大学出版社2000年版.

15、[美]基思. 卡思伯森. 金融工程— 衍生品与风险管理. (张陶伟彭永江译). 中国人民大学出版社, 2004.



[返回页首](#)