《金融工程（第4版）》勘误

|  |  |  |
| --- | --- | --- |
| 书中位置 | 原 文 | 修 订 （红色部分为修订） |
| P33倒数第8行 | 长期国债 | 国债 |
| P37第2行 | 经纪人 | 期货公司 |
| P37第4-5行 | 恢复 | 增加 |
| P37表2.9 | 2007年欧洲美元期货 | 2015年9月沪深300期货 |
| P68表4.2最后一个数字 | 12.26% | 11.59% |
| P84最后一行 | 11 | 28 |
| P93脚注 | 5.22 | 5.24 |
| P100第10行 | 右边那对箭头方向反了 | 上下边箭头正确的分别为：←→ |
| P101倒数第2行 | 银行 | 企业 |
| P104图6.6 | 外汇远期和互换 | 外汇远期和掉期 |
| P133第二节“一、”标题 | 利率互换后加上脚注 | 脚注：严格来说，利率互换的期限与下文需要转换的资产和负债的期限要相等。 |
| P135第一行“二、”标题 | 货币互换后加上脚注 | 脚注：严格来说，货币互换的期限与下文需要转换的资产和负债的期限要相等。 |
| P135案例8.5（2）） | 货币互换合约 | 10年期的货币互换合约 |
| P140第2段第2行 | 2015年10月28日之前 | 2015年10月28日之前 |
| P140第2段段数第2行和第3段第1行 | 2.15 | 0.0720 |
| P150第10行 | 5个期权价格 | 5个行权价格 |
| P154正文倒数第5行 | 本所不 | 本所不 |
| P155第3行 | 他必须在交易后的第二个营业日 | 他必须在交易后的第二个营业日 |
| P160第19行 | 按约定 | 有权利按约定 |
| P168正文倒数第1行 | ，也可表示为。 | 。 |
| P168脚注2 | 中国2015年股灾期间证监会限制融券期间 | 2015年中国股市异常波动期间 |
| P169第1和2行 | -1时刻 | 时刻 |
| P169第5行 |  |  |
| P196第1-3行 | 第1-3行改为 | 易证券的漂移率都等于无风险利率r①。同样。在风险中性条件下，所有现金流的期望值都应该使用无风险利率进行贴现求得现值。则就是风险中性定价原理。 |
| P196案例11.1第2段第1行 | 预期收益率等于无风险利率 | 预期回报按无风险利率贴现都等于其现在的价格$X-Xe^{-r\left(T^{\*}-T\right)}+c\_{2}-c\_{1}+c\_{1T}$ |
| P197第14-15行 | 由于不需要风险溢酬，人们对A股票的预期收益率就等于无风险利率10% | 所有课交易资产的预期回报按无风险利率贴现都等于其现在的价格 |
| P197第17和20行 | 预期收益率 | 漂移率 |
| P241第二段 | 第二段改为 | 一般来说，投资者构建牛市差价组合的主要原因是低行权价的期权价格相对较低，买低卖高的概率赔率组合较为有利。 |
| P242第一段 | 第一段改为 | 构造熊市差价组合的主要原因是高行权价的期权价格相对较低，买高卖低的概率赔率组合较有利。 |