

图书基本信息

书名：<<商业银行结构化理财产品开发与投资攻略>>

13位ISBN编号：9787121138485

10位ISBN编号：7121138484

出版时间：2011-7

出版时间：电子工业

作者：王凯涛

页数：265

字数：340000

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：<http://www.tushu007.com>

内容概要

本书从金融创新与金融工具等基本概念出发，对基本金融工具和衍生金融工具进行了详细的分析，阐述了结构化产品的基本要素、种类和设计原理；根据结构化产品挂钩标的资产的不同，详细解读了4类主要的结构化产品的设计原理和主要产品；从投资者的角度提出了结构化产品的投资要点，从产品开发者（商业银行）的角度概括了银行结构化理财产品开发过程中的风险管理实务，并从市场监管者的角度分析了我国商业银行结构化产品的现状、制约因素、发展前景，提出了中国发展结构化产品的路径。

此外，剖析了大量商业银行结构化产品的案例，并引用了部分报道和评论，突出了本书的可读性、操作性和实践性。

书籍目录

第1篇 引言篇

第1章 像雾像雨又像风——结构化理财产品的发展

1.1 结构化理财产品的含义

1.2 海外结构化商品的发展

1.2.1 欧美结构化商品的发展历程

1.2.2 亚洲结构化金融产品的发展

1.3 国内结构化产品的发展

1.4 本研究意义

第2篇 基础篇

第2章 明明白白我的“芯”——认识基本金融工具

2.1 金融工程与金融产品开发

2.2 金融产品开发的基本组件之一：债券

2.2.1 债券的定义

2.2.2 债券的分类

2.3 金融产品开发的基本组件之二：远期、期货与互换

2.3.1 金融衍生产品

2.3.2 远期、期货与互换合约

2.4 金融产品开发的基本组件之三：期权

2.4.1 期权

2.4.2 奇异期权

2.5 小结

第3章 不畏浮云遮望眼——结构化理财产品初步解构

3.1 结构化产品的基本要素

3.2 结构化产品的种类

3.3 高收益型结构化产品的设计原理

3.3.1 “看多型”高收益产品

3.3.2 “看空型”高收益产品

3.3.3 “空头价差型”高收益产品

3.3.4 “勒式”高收益产品

3.4 保本结构化产品的设计原理

3.5 结构化产品交易的前提条件

3.6 结构化产品的应用

第3篇 产品篇

第4章 利率挂钩结构化产品

4.1 引言

4.2 利率挂钩结构化产品主要计息方式与设计

4.2.1 正浮动型 (Floating Rate)

4.2.2 逆浮动型 (Inverse Floating Rate)

4.2.3 杠杆逆浮动型 (Levered Inverse)

4.2.4 区间型 (Range Notes , Accrual Notes)

4.2.5 目标赎回型 (Target Redemption)

4.2.6 滚雪球型 (Snowball)

4.2.7 阶梯型 (Step-up)

4.2.8 双指数浮动型 (Dual-Indexed)

4.2.9 本金浮动型 (Principal-Indexed Debt Securities)

- 4.2.10 基差浮动利率型 (Basis Floating Rate)
- 4.3 利率挂钩结构型银行理财产品的典型案例分析
 - 4.3.1 利率滚雪球型结构化产品
 - 4.3.2 目标赎回型 (Target Redemption Note)
- 4.4 产品创新研究
- 4.5 小结
- 第5章 股权挂钩结构化产品
 - 5.1 引言
 - 5.2 股票 (指数) 挂钩结构化产品设计的基本方法
 - 5.3 挂钩股权结构化产品的主要计息方式与设计
 - 5.3.1 气垫机制模式 (又称为触及生效模式)
 - 5.3.2 逐日计息模式
 - 5.3.3 提前赎回
 - 5.3.4 综合特点
 - 5.3.5 一日全收息
 - 5.3.6 触及取消
 - 5.3.7 取消折让累积
 - 5.3.8 挂钩多标的股票 (指数) 结构化产品的计息机制
 - 5.4 挂钩股权结构化产品的案例分析
 - 5.4.1 中国光大银行阳光理财“同升十五号”人民币A股关联结构化理财产品
 - 5.4.2 零息债券与买入亚式看涨期权所组合的产品
 - 5.4.3 零息债券与买入其他路径依赖看涨期权组合的产品
 - 5.4.4 路径依赖多股权 (指数) 标的期权产品
 - 5.5 小结
- 第6章 汇率挂钩结构化产品
 - 6.1 引言
 - 6.2 汇率挂钩结构化产品设计
 - 6.2.1 汇率挂钩保本型结构化产品
 - 6.2.2 汇率挂钩高收益型结构化产品
 - 6.3 投资的优点与风险
 - 6.3.1 主要收益
 - 6.3.2 主要风险
 - 6.4 小结
- 第7章 商品挂钩结构化产品
 - 7.1 引言
 - 7.2 挂钩黄金结构化理财产品
 - 7.2.1 主要收益结构
 - 7.2.2 黄金挂钩结构化产品的综合案例——恒生银行“黄金挂钩保本投资”
 - 7.3 挂钩石油的结构化理财产品
 - 7.4 挂钩低碳的结构化理财产品
 - 7.5 挂钩商品的结构化理财产品市场表现与展望
 - 7.5.1 市场表现
 - 7.5.2 未来展望：前景看好
- 第4篇 定价篇
- 第8章 结构化产品定价的基本理论与方法
 - 8.1 引言
 - 8.2 利率模型

- 8.2.1 均衡模型
- 8.2.2 无套利模型
- 8.2.3 市场模型
- 8.3 股指期货与外汇期权的定价模型
- 8.3.1 股价（指数）模型
- 8.3.2 汇率模型
- 8.4 资产相关性问题的解决方式
- 8.5 小结
- 第5篇 实务篇
- 第9章 超越贪婪与恐惧——商业银行结构化产品的投资要点
- 9.1 了解自己，做好理财规划
- 9.2 了解结构化产品
- 9.3 关注结构化产品的投资风险
- 9.4 如何选择合适的结构化产品
- 9.5 小结
- 第10章 商业银行结构型理财产品开发的风险管理实务
- 10.1 商业银行在结构化理财业务中面临的风险
- 10.1.1 市场风险
- 10.1.2 信用风险
- 10.1.3 信誉风险
- 10.2 商业银行结构型理财产品的风险管理
- 第11章 中国商业银行结构化产品的发展前景展望
- 11.1 引言
- 11.2 “金融海啸”与金融产品创新的“去杠杆化”
- 11.2.1 影响结构化产品创设的主要因素
- 11.2.2 次贷危机与金融海啸
- 11.2.3 “去杠杆化”将成为未来金融市场主流
- 11.3 我国发展结构化产品的积极意义与现实约束
- 11.3.1 发展结构化产品的积极意义
- 11.3.2 发展我国结构化产品的必然性
- 11.3.3 我国发展结构化产品的现实约束
- 11.4 中国发展结构化产品的路径选择
- 11.4.1 加强产品开发能力，加强结构化产品的风险管理
- 11.4.2 加强投资者教育，培育合格的投资者
- 11.4.3 积极审慎地发展我国的金融衍生产品市场
- 11.4.4 改善结构化理财产品监管
- 11.5 小结
- 附录A 信用衍生产品与信用挂钩结构化产品
- 附录B 香港金管局关于其他地区关于结构性产品销售监管做法的总结和相关建议
- 后记
- 参考文献

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:<http://www.tushu007.com>