

<<固定收益证券>>

图书基本信息

书名：<<固定收益证券>>

13位ISBN编号：9787307039865

10位ISBN编号：7307039869

出版时间：2005-2

出版时间：武汉大学出版社

作者：林清泉 编

页数：353

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>

<<固定收益证券>>

内容概要

与固定收益证券市场的发展水平相类似，我国对固定收益证券的理论和应用研究也处于刚起步的阶段。

目前，国内有关固定收益证券的教材更多地是介绍一些有关债券的基础知识，或者是从宏观上介绍中国债券市场，侧重于定性描述，详细地介绍了利率期限结构理论、固定收益证券的定价理论以及固定收益证券特征。

具体而言，本教材的内容主要包括以下几个部分：第一部分内容是有关利率的一些基本知识。本书从介绍货币的时间价值着手，介绍了即期利率、远期利率和折现因子的计算以及它们之间的相互关系，在此基础上介绍了利率期限结构理论。

第二部分内容是固定收益证券的定价理论。

对于固定现金流的固定收益证券，可以采用折现因子、即期利率、远期利率和到期收益率的多种定价方法。

对于嵌有期权的固定收益证券的定价，实质上是对利率衍生产品的定价，主要有无套利和风险中性定价两种方法。

第三部分内容是对固定收益证券一些特征的定量描述，主要包括PVBP、久期和凸现。

第四部分内容是对固定收益证券产品的介绍，分别介绍了国债、市政债券、国际债券、资产支持债券、抵押支持债券以及固定收益证券的一些衍生产品，最后还介绍了中国的固定证券市场。

第五部分内容是固定收益证券的投资策略。

<<固定收益证券>>

书籍目录

前言第一章 货币的时间价值第一节 利息和利率第二节 到期收益北第三节 即期利率和远期利率第
四节 利率期限结构本章小结思考题练习题参考文献第二章 固定收益债券定价理论第一节 固定收
益证券的定价方法第二节 债券的到期期限、价格和回报率第三节 实际债券价格本章小结思考题练
习题参考文献第三章 利率衍生产品的定价和短期利率动态模型第一节 利率衍生产品的无套利定价
第二节 风险中性定价第三节 多期的无套利定价第四节 短期利率动态模型本章小结思考题练习
参考文献第四章 价格敏感性的分析第一节 价格的利率函数和安的微分第二节 债券价格对利率的
敏感性度量.....第五章 国债以及政府机构债券第六章 市政债券第七章 公司债券第八章 国际债
券第九章 资产支持债券第十章 抵押支持债券第十一章 固定收益证券的衍生产品第十二章 债券
管理和投资技巧第十三章 中国固定收益证券市场后记

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>