

<<固定收益数学>>

图书基本信息

<<固定收益数学>>

内容概要

在20世纪80年代初以前，固定收益分析是一个清晰、简单的过程。

之后，复杂固定收益证券的引进使人们需要用更复杂的分析评估这些证券的价格和价格波动率特征。弗兰克·J·博齐的《固定收益数学》从金融数学的基本原理开始，详尽介绍了债券的定价基础、收益率测度、收益曲线、投资收益和利率第三度等概念，并提供了对美国规模最大的债券市场工具——房产抵押贷款证券——的现金流和定价分析。

该书无论对初涉债券市场的投资者、具有一定实战经验的交易员或对债券金融学感兴趣的读者而言，都是一本颇有裨益的债券数学教科书。

<<固定收益数学>>

作者简介

弗兰克·J.法博齐是耶鲁大学管理学院的金融学兼职教授和《投资组合管理杂志》的编辑。他是一位注册金融分析师和注册公共会计师。在担任耶鲁大学教授前，法博齐博士是MIT斯隆管理学院的教授。他是多本享有盛誉的固定收益证券和投资书籍的编者和作者，包括《固定收益期权手册

<<固定收益数学>>

书籍目录

译者序前言鸣谢 第一章 引言第一部分 金钱的时间价值 第二章 未来价值 第三章 现时价值 第四章 收益率（内部收益率）第二部分 无期权债的定价和收益率测度 第五章 债券的价格 第六章 债券的传统收益率测度 第七章 收益曲线、即期利率曲线和远期利率第三部分 投资收益分析 第八章 潜在的美元收益来源 第九章 总收益率 第十章 测量历史业绩第四部分 无期债券的价格波动率 第十一章 无期债券的价格波动率特性 第十二章 价格波动率测度：PVBP和价格变化的YV 第十三章 价格波动率测度：久期 第十四章 价格波动率测度：凸性 第十五章 久期与收益曲线第五部分 分析含内嵌期权的债券 第十六章 买权：投资特征和价格特征 第十七章 含内嵌期权的债券的定价和价格波动率第六部分 分析房产抵押贷款证券 第十八章 房产抵押贷款的现金流特征 第十九章 房产抵押贷款证券的现金流特征 第二十章 房产抵押贷款证券的分析第七部分 统计和优化技术 第二十一章 概率理论 第二十二章 模拟 第二十三章 回归分析 第二十四章 优化模型索引

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>