第一图书网, tushu007.com

<<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：9787301110485

10位ISBN编号：7301110480

出版时间：2006-9

出版时间：北京大学

作者：姚长辉

页数：471

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

本书将前沿理论与大量实例相结合，围绕定价与风险管理，在介绍固定收益证券的基本特征、品种、风险类别的基础上，阐述分析了到期收益率曲线及利期限结构、债券合成及套利机会的寻找、持续期与凸性在投资组合风险管理中的应用、互换的定价与风险特征、利率远期、期货与回购协议的定价原理与风险管理、含权证券的价值分析以及资产证券化的原理、步骤、定价与风险特征等若干重要的内容。

本书适合高等院校经济类、管理类专业的研究生、MBA以及金融业专业人士阅读。

作者简介

姚长辉，1964年生于辽宁省北镇县。
1982年就读于北京大学，并在北京大学先后获得经济学学士、经济学硕士、金融学博士学位。
1989年起任教于北大，1993年任副教授，2001年任教授、博士生导师。
现任北京大学光华管理学院MBA中心主任，金融系副主任，北京大学金融与证券研究中心副主任，北京大学风险投资研究中心副主任，中国金融学会理事，北京市金融学会理事，北京市投资学会理事，《经济科学》编委。

研究领域为货币银行、固定收入证券等。
主持了多项国家级和省部级科研项目。
至今在经济学、金融学核心期刊上发表论文50多篇，出版专著、教材8部。
科研成果多次获奖，曾获得“霍英东科研奖”（1995）、“安子介科研奖”（1996）两项国家级奖励。

1995年10月-12月，在澳大利亚新南威尔士大学做访问学者。
1998年8月-1999年7月，在美国沃顿商学院从事金融学研究。
2000年8-10月，在香港中文大学从事合作研究。
2002年9月-2003年3月，在美国西北大学凯洛格商学院做访问教授。

<<固定收益证券>>

书籍目录

第一章 固定收益证券概述 第一节 固定收益证券的重要地位 第二节 固定收益证券的特征 第三节 固定收益证券的风险 第四节 计息与计价习惯 第五节 国外固定收益证券种类 第六节 中国市场中的债券种类与创新第二章 到期收益率与总收益分析 第一节 到期收益率 第二节 到期收益率曲线与折现方程 第三节 收益率隘价 第四节 持有收益率与总收益分析 第五节 再投资收益率风险第三章 零息债券与附息债券分析 第一节 零息债券 第二节 债券合成 第三节 寻找套利机会 第四节 债券价格的时间效应——θ值第四章 持续期与凸性 第一节 影响债券价格一利率 第二节 持续期 第三节 凸性 第四节 持续期免疫与避险第五章 互换 第一节 互换的基本概念与互换种类 第二节 互换的利益来源与互换市场发展 第三节 互换的定价 第四节 互换的风换 第五节 P&G公司的案例第六章 利率远期、期货与回购协议 第一节 利率远期与期货的基本概念 第二节 远期的定价原理 第三节 欧洲美元期货 第四节 美国国债期货 第五节 回购协议第七章 利率期限结构理论 第一节 传统利率期限结构的基本理论 第二节 用现代手段构建利率期限结构第八章 含权证券的价值分析 第一节 期权的特点 第二节 Black-Scholes模型在含权证券定价中的问题 第三节 二项式模型与无风险定价 第四节 二项式模型与含权证券定价 第五节 可转债的定价第九章 资产证券化 第一节 资产证券化概述 第二节 MBS与住房贷款规模扩张 第三节 转手证券的创新 第四节 基于转手证券之上的衍生证券的创新 第五节 MBS的定价 第六节 MBS的风险指标 第七节 我国资产证券化的进展各章部分习题参考答案参考文献术语索引

编辑推荐

《固定收益证券：定价与利率风险管理》适合高等院校经济类、管理类专业的研究生、MBA以及金融业专业人士阅读。

第一图书网, tushu007.com

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