

<<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：9787301156322

10位ISBN编号：7301156324

出版时间：2011-9

出版时间：北京大学出版社

作者：陈蓉，郑振龙 主编

页数：345

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

《固定收益证券》是一本关于固定收益证券定价和利率风险管理的教材，涵盖固定收益证券领域的传统知识与最新发展。

《固定收益证券》分为三大部分：第一章对固定收益证券和国内外市场现状进行了概述；第二章至第六章为初级部分；包括基本固定收益证券的分析与定价、静态利率期限结构模型、初级利率风险管理技术和固定收益证券资产组合管理策略；第七章至第九章为高级部分。

详细介绍了利率期限结构动态模型、利率期权定价方法和高级利率风险管理技术，其中对利率期限结构的静态主成分分析、因子分析、曲线拟合技术、动态利率模型原理和运用的详细介绍是本教材的最大特色。

全书强调知识的应用性，强调理论模型的严谨性，配有大量丰富且贴近观实的案例，注重市场直觉的培养，力求为读者提供易于理解和可直接应用的知识 and 工具。

《固定收益证券》可作为普通高等院校金融学、金融工程等专业“固定收益证券”课程本科生和研究生的教科书，还可作为金融机构从业人员的培训教材及相关领域研究人员、行业监管人员的参考书。

## <<固定收益证券>>

### 作者简介

陈蓉，经济学（金融学）博士，厦门大学金融系金融工程教授、博士生导师，美国康奈尔大学金融计量与金融工程方向博士后，曾赴美国北卡罗来纳大学夏洛特分校数学与统计学系访问并授课。先后发表了20多篇学术论文，出版了近10部著作和教材，作为主持人和主要参与者承担了6项国家和省部级科研课题的研究，主持了7项横向课题，并多次获奖。近年来的研究领域包括：金融工程、固定收益证券、风险管理与金融计量。

郑振龙，厦门大学金融学国家重点学科学术带头人、经济学（金融学）博士、金融工程教授、博士生导师。国务院学科评议组成员、国务院政府特殊津贴专家、闽江学者特聘教授。曾以富布赖特研究学者身份留学美国加州大学洛杉矶分校（UCLA）、以高级研究学者身份留学英国伦敦经济学院（LSE）。

## &lt;&lt;固定收益证券&gt;&gt;

## 书籍目录

- 第一章 固定收益证券概述
  - 第一节 理解固定收益证券
  - 第二节 基础性债务工具
  - 第三节 固定收益证券衍生品
  - 第四节 结构性债务工具
  - 第五节 固定收益证券市场
- 第二章 债券价格与收益率
  - 第一节 货币的时间价值
  - 第二节 利率
  - 第三节 债券定价
  - 第四节 债券的收益率分析
  - 第五节 债券的报价 附录
- 第三章 利率远期、利率期货与利率互换
  - 第一节 利率远期
  - 第二节 利率期货
  - 第三节 利率互换
- 第四章 利率期限结构：静态模型
  - 第一节 利率期限结构概述
  - 第二节 利率期限结构变动的因子分析
  - 第三节 传统的利率期限结构理论
  - 第四节 利率期限结构的拟合 附录
- 第五章 利率风险管理
  - 第一节 利率风险的度量
  - 第二节 基于久期和凸性的利率风险管理
- 第六章 固定收益证券组合管理
  - 第一节 保守的组合管理策略
  - 第二节 积极的组合管理策略
  - 第三节 对冲型组合管理策略 附录：中债指数编制说明
- 第七章 利率期限结构：动态模型
  - 第一节 动态利率模型概述
  - 第二节 仿射利率期限结构模型
  - 第三节 hjm分析框架与无套利模型
  - 第四节 动态利率模型参数的估计与校准 附录
- 第八章 利率期权定价
  - 第一节 债券期权
  - 第二节 可赎回与可回售债券
  - 第三节 利率顶和利率底
  - 第四节 利率互换期权
- 第九章 高级利率风险管理
  - 第一节 期权调整利差分析法
  - 第二节 在险值
- 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>