

<<固定收益证券的投资价值分析>>

图书基本信息

书名：<<固定收益证券的投资价值分析>>

13位ISBN编号：9787505852280

10位ISBN编号：7505852280

出版时间：2006-1

出版时间：经济科学出版社

作者：文忠桥

页数：237

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>

## <<固定收益证券的投资价值分析>>

### 内容概要

本书以现代金融理论为基础，从一个全新的视角研究固定收益证券的投资价值。作者研究了利率期限的结构理论，重点研究了固定收益证券的定价，多侧面地研究固定收益证券的定价，多侧面地研究固定收益证券的利率风险管理和违约风险管理等固定收益证券的风险管理理论。全书理论联系实际，针对我国债券市场的现状，提出了解决我国债券问题的对策和建议。

## <<固定收益证券的投资价值分析>>

### 作者简介

文忠桥，1964年4月生于湖南祁阳。

1988年毕业于湖南师范大学数学系，获理学学士学位；1996年毕业于安徽财贸学院金融系，获经济学硕士学位；2003年毕业于中国人民大学财金学院，获经济学博士学位。

现任安徽财经大学经济与金融学院副教授、金融研究所副所长。

主要从事金融资产定价和风险管理方面的理论研究。

近年来，在《数量经济技术经济研究》、《南开经济研究》、《国际金融研究》等杂志发表论文多篇，主持和参加安徽省社会科学基金、安徽省教育厅自然科学基金、安徽省人文重点研究基地等项目研究。

## &lt;&lt;固定收益证券的投资价值分析&gt;&gt;

## 书籍目录

第1章 导论1.1 本书的基本框架和内容概要1.2 学术探索与创新1.3 研究方法第2章 利率期限结构理论、模型和实证分析2.1 利率期限结构理论2.1.1 预期假说2.1.2 市场分割理论2.1.3 流动性偏好假说2.2 名义利率期限结构模型2.2.1 单因子模型2.2.2 多因子模型2.3 实际利率期限结构2.3.1 确定性背景下的实际利率期限结构2.3.2 不确定性背景下的实际利率期限结构2.4 我国固定收益证券利率期限结构的实证分析第3章 固定收益证券的定价3.1 无套利均衡分析3.2 风险中性定价3.3 利用期限结构模型定价3.3.1 利用单因子期限结构模型定价3.3.2 利用多因子模型定价3.4 公司债券的定价3.4.1 普通公司债券的定价3.4.2 可转换债券的定价3.5 固定收益证券定价的实证分析3.5.1 国债无风险随机利率动态方程3.5.2 国债定价结果分析第4章 固定收益证券定价的数值解法4.1 网格分析方法4.1.1 单期二项式定价方法4.1.2 多期二项式定价及其极限4.2 有限差分方法4.2.1 显式差分格式4.2.2 隐式差分格式4.2.3 crank—Nicolson差分格式4.2.4 有限差分方法的边界条件4.3 蒙特卡罗模拟方法4.3.1 蒙特卡罗模拟的基本步骤4.3.2 蒙特卡罗模拟的方差技术4.4 数值方法定价实例第5章 固定收益证券的利率风险5.1 久期和凸性5.2 非随机利率期限结构时的债券免疫5.2.1 利率结构平行移动时的免疫5.2.2 利率期限结构倍数增减时的免疫5.2.3 利率期限结构受到倍数增减和平行移动冲击时的债券免疫5.2.4 利率期限结构受到非线性冲击时的债券免疫5.3 随机利率期限结构模型下的债券免疫5.3.1 HJM远期利率期限结构下债券的免疫5.3.2 瓦西塞克利率期限结构模型下的债券免疫5.4 债券的利率风险免疫实例分析第6章 固定收益证券的违约风险6.1 公司债券的信用评级6.2 KMV模型6.3 保险模型6.3.1 死亡率模型6.3.2 信用风险附加模型6.4 债券组合管理的违约风险6.4.1 奥特曼的方法6.4.2 Moody's公司的债券组合模型6.5 中国公司债券的违约风险参考文献后记

<<固定收益证券的投资价值分析>>

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>