

<<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：9787801442666

10位ISBN编号：7801442660

出版时间：1999-09

出版时间：宇航出版社

作者：(美)布鲁斯.塔克曼(Bruce Tuckman)

页数：313

字数：230000

译者：黄嘉斌

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

近一段时期，一种多变的新型固定收益证券席卷了证券交易市场，与传统的固定收益证券相比，新型固定收益证券给投资者带来了更大的利润和更大的潜在风险。

但在传统固定收益证券市场中屡试不爽的“不精确大拇指原则”在现代市场中一旦遇到浮动利率证券、反转浮动、利率交换等新问题时就无法应用了。

本书贯穿同一组市场数据，以息票债券、无息债券和永久债券的定价过程为基础，步步为营地解析了折现率、收益率曲线、远期利率、抵押债券、可赎回债券以及远期、期货、利率交换交易等衍生工具的价格计算过程，既给出了一套体系完整的例题，又示范了现代金融市场实际运作的价格计算规则。

<<固定收益证券>>

作者简介

布鲁斯·塔克曼：SALOMON兄弟有限公司副总裁，纽约大学商学院金融专业教授。

<<固定收益证券>>

书籍目录

第1部分 传统固定收益证券的相对订价方法 第1章 债券价格与折现因子 第2章 债券价格与利率：即期与远期 第3章 到期殖利率 第4章 实际资料的处理问题 第2部分 或然性利率合约的相对订价导论 第5章 衍生性合约的无套利机会订价 第6章 中性风险偏好的订价 第7章 合理假设下的无套利机会订价 第8章 期限结构模型的艺术 第9章 无套利机会模型与均衡模型的比较 第3部分 衡量价格的敏感性导论 第10章 价格-殖利率函数与导函数 第11章 价格敏感性的衡量方法 第12章 麦氏存续期限与修正存续期限 第13章 关键利率的存续期限 第4部分 实际运用 第14章 远期与期货合约 第15章 浮动与逆浮动利率债券 第16章 利率交换交易 第17章 嵌入选择权的公司债 第18章 抵押贷款证券

<<固定收益证券>>

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>