

# 《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：9787111454561

出版时间：2014-3-1

作者：李磊宁,高言,戴韡

页数：353

版权说明：本站所提供下载的PDF图书仅提供预览和简介以及在线试读，请支持正版图书。

更多资源请访问：[www.tushu000.com](http://www.tushu000.com)

# 《固定收益证券》

## 内容概要

《精品规划教材·高等院校金融学系列:固定收益证券》围绕着债券这个金融工具展开讨论,内容主要涉及债券的性质与价格波动特点;哪些因素(以什么样的方式)影响着债券价格的形成与变动;各类债券的定价方法是什么;债券在市场上是如何交易的;政府是如何运用法律法规对债券发行和交易实施监管的;如何利用债券进行融资;债券投资与交易的策略是什么;怎样才能控制债券的风险。

## 书籍目录

### 第1章 债券概论

- 1.1 固定收益证券与债券
- 1.2 债券的要素与分类
- 1.3 债券的演变
- 1.4 债券的报价
- 1.5 债券的功能

#### 练习题

#### 参考文献

### 第2章 债券价格与债券收益率

- 2.1 货币的时间价值——终值与现值
- 2.2 利率
- 2.3 债券定价
- 2.4 债券收益率
- 2.5 息票效应——再谈到期收益率
- 2.6 买1年期债券还是买2年期债券？——对远期利率的再认识

#### 练习题

#### 参考文献

### 第3章 债券价格的利率敏感性

- 3.1 什么是债券价格的利率敏感性
- 3.2 久期
- 3.3 基点值
- 3.4 凸性
- 3.5 图形引起的误导

#### 练习题

#### 参考文献

### 第4章 利率期限结构

- 4.1 什么是利率期限结构
- 4.2 连续复利条件下的利率、贴现函数与债券价格
- 4.3 利率期限结构的功能
- 4.4 利率期限结构的构造
- 4.5 利率期限结构的动态变化特性初探：基于主成分及因子分析的实证结论
- 4.6 久期理论的拓展：费雪—威尔久期与关键利率久期

#### 练习题

#### 参考文献

### 第5章 动态利率期限结构模型

- 5.1 动态利率期限结构模型概述
- 5.2 均衡模型
- 5.3 无套利模型
- 5.4 模型应用探讨

#### 练习题

#### 参考文献

### 第6章 债券市场

- 6.1 债券市场的发展历程
- 6.2 发行市场
- 6.3 交易市场
- 6.4 交易品种
- 6.5 交易流程

6.6 交易市场的两个重要领域

6.7 托管与结算

6.8 市场监管

附录6A 我国债券市场的监管主体与监管内容

练习题

参考文献

第7章 信用类债券

7.1 信用类债券概述

7.2 信用风险

7.3 信用类债券的估值

7.4 税后收益率与课税等价收益率

7.5 信用类债券的久期

附录7A 厦路桥MTN1的募集说明书目录

练习题

参考文献

第8章 含权债券

8.1 含权债券概述

8.2 可赎回债券的性质与定价

8.3 可售回债券的性质与定价

8.4 可转换债券

8.5 静态利差与期权调整利差

练习题

参考文献

第9章 资产证券化产品

9.1 资产证券化概述

9.2 抵押支持债券定价方法

9.3 资产证券化的风险分析

练习题

参考文献

第10章 债券衍生品

10.1 利率远期

10.2 国债期货

10.3 利率互换

10.4 利率期权

10.5 信用违约互换

练习题

参考文献

第11章 债券融资

11.1 公债融资

11.2 私债融资

附录11A 当前我国债券融资的费用（以发行企业债券为例）

练习题

参考文献

第12章 债券投资

12.1 债券投资概述

12.2 主要债券投资者及行为特征

12.3 债券交易策略

附录12A 持有期与组合平均久期相等从而实现利率免疫的证明

附录12B 跟踪误差最小化投资组合的投资比例的求解过程

附录12C 例12—13中的利差数据

练习题

参考文献

第13章 债券风险管理

13.1 金融风险管理

13.2 信用风险

13.3 市场风险

13.4 流动性风险

13.5 操作风险

13.6 道德风险

练习题

参考文献

部分习题答案

# 《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：[www.tushu000.com](http://www.tushu000.com)