

# 《债券与债券衍生产品》

## 图书基本信息

书名：《债券与债券衍生产品》

13位ISBN编号：9787564219491

出版时间：2015-3

作者：迈尔斯·利文斯顿

页数：250

译者：周琼琼,李成军

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)

# 《债券与债券衍生产品》

## 内容概要

《债券与债券衍生产品(第二版)》主要有十四章，各个章节讲述的主要内容分别是：第一章利率水平的确定因素；第二章发行人；第三章金融中介；第四章时间价值；第五章货币市场工具和利率；第六章利率变化风险；第七章非水平利率期限结构的时间价值；第八章套利；第九章利率的期限结构；第十章违约风险；第十一章看跌期权和看涨期权；第十二章债券的赎回条款；第十三章抵押贷款；第十四章期货合约。

# 《债券与债券衍生产品》

## 书籍目录

- 总序
- 前言
- 致谢
- 引言
- 债务的增长
- 利率波动率增加
- 各种新的债务工具
- 本书的目标
- 第一章利率水平的确定因素
- 美联储
- 外国中央银行
- 可贷资金法
- 通货膨胀和利率
- 总结
- 第二章发行人
- 美国财政部
- 指数化债券
- 政府支持企业
- 市政债券
- 抵押贷款
- 公司
- 总结
- 第三章金融中介
- 债券的首次发行（一级市场）
- 自营商和经纪人（二级市场）
- 共同基金
- 保险公司
- 养老基金
- 商业银行和储蓄机构
- 债务融资类型的比较
- 总结
- 第四章时间价值
- 时间线
- 终值
- 现值
- 用现值计算终值
- 债券的价格
- 债券到期收益率
- 其他收益率的计算
- 永续债券
- 持有期收益率
- 半年付一次利息
- 应计利息
- 报纸和网络报价
- 总结
- 附录
- 第五章货币市场工具和利率

# 《债券与债券衍生产品》

货币市场工具

货币市场利率

总结

第六章利率变化风险

久期

投资期限免疫

资产和负债免疫

总结

附录

第七章非水平利率期限结构的时间价值

即期利率

现值或即期价格

本息分离债券

远期利率

期限结构的形状

年金

附息票债券的价格

到期收益率和即期利率

利率期限结构的估计方法

总结

附录

第八章套利

卖空

套利的条件

套利和现值

套利和债券息票

累计现金流起作用的一个例子

复制投资组合的一个例子

根据即期证券创设远期合约

套利和远期利率

债券价格和息票之间线性关系的套利证据

寻找套利机会

总结

第九章利率的期限结构

收益率曲线历史形态

市场分割理论

增加流动性溢价

偏好停留理论

货币替代

预期假说

组合理论

弯曲的收益率曲线

持有期收益率

现代期限结构模型

总结

第十章违约风险

市政债券违约

抵押贷款违约

公司债券

# 《债券与债券衍生产品》

债券评级

高收益（垃圾）债券

总结

第十一章看跌期权和看涨期权

看涨期权

看跌期权

看跌期权—看涨期权平价

看涨期权价值的决定因素

员工股票期权

总结

.....

第十二章债券的赎回条款

第十三章抵押贷款

第十四章期货合约

# 《债券与债券衍生产品》

## 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)