

《利息理论及其应用》

图书基本信息

书名：《利息理论及其应用》

13位ISBN编号：9787300184162

出版时间：2014-2-1

作者：孟生旺

页数：187

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

《利息理论及其应用》

内容概要

本书的框架结构主要参考北美精算师协会资格考试中利息理论部分的内容进行安排，全书分为两部分：第一部分是理论部分，主要介绍了利息的各种度量方法和年金价值的计算；第二部分是应用部分，主要介绍了收益率的计算和收益分配、债务偿还方法、债券价值分析和利率风险管理等。

本书虽然以量化分析为主，但刻意回避了一些比较繁琐的数学证明，把重点放在了对有关结果的经济解释和直观说明上，这种解释和说明虽然不如数学证明严谨，但更加便于读者对有关结论的理解和应用。

本书适用于经济、管理、金融和保险等相关专业的本科生使用，也可作为精算师资格考试的参考教材使用。

《利息理论及其应用》

作者简介

孟生旺，中国人民大学统计学院教授，博士生导师。主要研究方向：精算模型，非寿险精算，风险度量，风险管理等。曾出版《金融数学》、《保险精算学》、《非寿险精算学》等教材和专著。

书籍目录

第1章 利息度量方法

- 1.1 累积函数与实际利率
- 1.2 单利
- 1.3 复利
- 1.4 贴现函数
- 1.5 贴现率
- 1.6 名义利率
- 1.7 名义贴现率
- 1.8 利息力
- 1.9 利率概念辨析

第2章 等额年金

- 2.1 年金的现值
- 2.2 年金的终值
- 2.3 年金现值与终值的关系
- 2.4 年金在任意时点上的值
- 2.5 每年支付 m 次的年金
- 2.6 连续支付的等额年金
- 2.7 价值方程

第3章 变额年金

- 3.1 递增年金
- 3.2 递减年金
- 3.3 复递增年金
- 3.4 每年支付 m 次的变额年金
- 3.5 连续支付的变额年金
- 3.6 连续支付连续递增的年金
- 3.7 连续支付连续递减的年金

第4章 收益率和收益分配

- 4.1 收益率和投资分析
- 4.2 币值加权收益率
- 4.3 时间加权收益率
- 4.4 再投资收益率
- 4.5 收益分配

第5章 债务偿还方法

- 5.1 等额分期偿还
- 5.2 等额偿债基金
- 5.3 变额分期偿还
- 5.4 变额偿债基金

第6章 债券价值分析

- 6.1 债券定价原理
- 6.2 债券在任意时点上的价格和账面值
- 6.3 分期偿还债券的价格
- 6.4 可赎回债券的价格

第7章 利率风险管理

- 7.1 马考勒久期
- 7.2 修正久期
- 7.3 有效久期
- 7.4 凸度

《利息理论及其应用》

7.5 久期和凸度在债券价值分析中的应用

7.6 免疫

7.7 完全免疫

7.8 现金流配比

参考答案

参考文献

《利息理论及其应用》

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