

# 《利率曲线及其构造》

## 图书基本信息

书名：《利率曲线及其构造》

13位ISBN编号：9787309065039

10位ISBN编号：7309065034

出版时间：2009-9

出版社：复旦大学出版社

作者：周星

页数：154

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)

# 《利率曲线及其构造》

## 前言

首先，这是一本金融书，而不是一本数学书。尽管现代金融学，特别是定量金融学（Quantitative Finance），离不开数学，但是这门学科的目的是研究和解决金融问题而不是研究数学问题。更准确地讲，这门学科是用现代数学手段描述、分析和解决相关的金融课题。现在有许多讲述定量金融学书都过分强调数学意义上的严谨性，有的甚至花三分之一或者更多的篇幅讲述以概率论和随机变量积分（Stochastic Calculus）为代表的纯数学知识，剩下的篇幅则是用数学公式来推导定量金融学的结论。这样的写法当然有一定的道理和必要（毕竟定量金融学需要定量，定量就需要数学），但是对许多初学者和只是想了解一些定量金融学基本概念和方法的金融工作者来说，那样的书实在有些读不下去的感觉。本书希望从非常容易理解的概念和常识起笔，强调对金融概念的理解和把握，逐步展开，并适当地引入相关的数学公式，但始终围绕着构造利率曲线这个主题。作者的宗旨是写一本非数学专业的本科生能读懂的书，一本抛砖引玉的书。当读完这本书后，如果读者希望作进一步研究的话，可以参阅相关的其他书籍。

其次，这是一本专注于利率曲线及其构造的书。定量金融学涉及的内容博大精深，有关的书籍也为数众多，但是专注于利率曲线及其构造的书籍却是凤毛麟角。利率曲线是定量金融学，特别是利率金融学中最重要、最基本的内容之一，在实践中几乎天天都会用到。尽管绝大多数相关的书籍都会提到利率曲线及其构造，但是这个内容往往是被短短几页纸一笔带过。偶尔，也会有一些专门介绍利率曲线及其构造的论文，但是这些至多一二十页的论文通常只是提出一种新的利率曲线拟合的数学方法，并在理论上加以阐述而已。

# 《利率曲线及其构造》

## 内容概要

《利率曲线及其构造》专注于利率曲线及其构造的介绍，尽管书中大量运用了现代数学的描述手段，但研究的是金融问题而不是数学问题，内容展开的重点是对金融概念的理解与把握。由于利率曲线的构造有很强的实践性，书中还专门讲解了相关的软件编程知识。利率曲线的构造，是定量金融学中的一项极为重要的内容之一。对于金融业的从业人员来说，利率曲线构造的水准直接影响金融产品交易员的业绩，也考量了投资银行风险管理的能力。

《利率曲线及其构造》是国内较为少见的专述利率曲线的著作，加之作者有在华尔街从业的宝贵经历和实践经验，使《利率曲线及其构造》既能作为高校金融类专业师生的教学读物，也能为金融从业人员提供相应的理论知识和工作借鉴。

# 《利率曲线及其构造》

## 书籍目录

序言1 利率及贴现率 1.1 利息与利率 1.2 利息的计算 1.3 零利率、现期利率和远期利率 1.4 即时利率 (Instantaneous Interest Rate) 1.5 现值和贴现率 1.6 现金流及其现值2 利率金融产品 2.1 利率曲线和利率金融产品 2.2 定期存款及欧洲美元期货 (Euro Dollar Future) 2.3 远期利率协议 (Forward Rate Agreement FRA) 2.4 债券 (Bond) 2.5 利率掉期 (Interest Rate Swap) 2.6 小结3 日期序列 3.1 到期日、付款日及日记数基准 3.2 结算日 (Spot Day) 3.3 起息日、止息日和指标利率起、止日 3.4 指标利率确定日 (Reset Day) 和利率截止日 (Rate Cut-off Day) 3.5 利率掉期日期序列的生成4 利率曲线及其构造 4.1 利率曲线 4.2 利率曲线的判断标准 4.3 利率曲线的形状 4.4 利率曲线函数 4.5 一个简单的利率曲线求解的例子 4.6 同一个例子的另解 (Bootstrapping) 4.7 利率的补偿和调整 4.8 利率曲线间的关系 4.9 一个相对完整的例子 4.10 小结 4.11 利率曲线构造的最新探索5 一些细节和实际问题 5.1 计算非标准期限的远期利率 5.2 日期序列的数据结构 5.3 利用利率掉期构造利率曲线的进一步讨论 5.4 掉期利率和掉期利差的计算 5.5 双重用途利率曲线的利率补偿和调整 5.6 对指标利率曲线和贴现率曲线之间关系的再思考 5.7 数据的缓冲 5.8 多线程环境下的利率曲线构造6 数值计算 6.1 数值计算 6.2 内插值 (Intrapolation) 和外插值 (Extrapolation) 6.3 向量和矩阵 6.4 非线性方程的求根 6.5 多变量的优化和求最小值7 基于利率曲线的风险预估 7.1 市场价格对利率曲线的影响 7.2 利率曲线对投资组合的影响 7.3 动态利率曲线和利率模型 7.4 蒙特卡罗方法和随机数8 一个典型的利率曲线程序库的组成 8.1 利率金融产品类库 8.2 插值函数集合 8.3 通用数学子程序 8.4 利率曲线类库附录 1 月份代码 2 常见的日期调整规则 (Date Shift Convention) 3 麦氏久期的直观解释

# 《利率曲线及其构造》

## 精彩短评

- 1、讲得比较空
- 2、工具书，工作需要，很好
- 3、很少人看，但看的人都会觉得是精品。
- 4、当当网上的书价廉质优，非常好。
- 5、薄，但是内容不错

# 《利率曲线及其构造》

## 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)