

<<固定收益证券的估值、定价与计算>>

图书基本信息

书名：<<固定收益证券的估值、定价与计算>>

13位ISBN编号：9787303118076

10位ISBN编号：7303118071

出版时间：2011-1

出版时间：北京师范大学出版社

作者：李磊宁，周欣 著

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>

## <<固定收益证券的估值、定价与计算>>

### 内容概要

本书的特色，是运用国际前沿金融理论与金融分析技术，探讨中国债券市场的估值与价格计算问题。这一特色使得本书在以下几个方面与现有的同类专业书籍存在显著不同：第一，本书以中国债券市场作为债券估值与定价的分析背景，绝大多数案例与算例都采用中国债券市场的债券品种与真实的交易数据；第二，本书不但介绍了相关的金融理论与利率模型，还探讨了它们在中国的应用以及存在的问题；第三，作者尽量利用计算机软件作为辅助的分析工具，以便帮助读者提高其金融分析与操作技能。书中相当多的算例中都涉及MATLAB金融工具箱的运用，一部分重要的算例中的MATLAB源代码也附在相关章节的附录中，以便读者查验。

本书由12章构成。

第1章与第2章可以看做是一个单元，这个单元是对中国债券品种、交易方式与市场机制的扫描，为接下来各章的分析提供了不可缺少的实务背景，就像演员表演之前，观众要先看到舞台一样。

第3章到第6章是本书的核心单元，内容涉及无信用风险的债券(即国债)估值与定价的各个方面，包括影响债券价格波动的因素，债券价格方程与债券的各类收益率，债券价格(由利率变动引起的)波动的衡量，利率期限结构与收益率曲线，利率动态模型。

本单元并非是对国外金融理论的简单介绍，而是结合许多市场实例，提供了对理论的验证过程，并分析了中国债券市场的定价问题。

本单元的部分分析方法将在以后的单元中得到运用。

第7章到第9章是一个单元，针对含权债券、企业债务工具、资产抵押债券这些特殊的债券品种的分析构成本单元的内容。

这些特别的债券在我国有很大发展潜力，现实中存在的定价问题也比较多，第7章对可转换债券定价的讨论，第8章对我国公司债券利差因素分析和税收问题的分析，第9章对我国MBS产品的案例解析，为读者提供了一个现实市场背景下这类债券的分析框架。

第10章与第11章是一个单元，作者分别从组合管理和风险管理的角度，阐述了债券投资管理的内容。

第12章单独构成一个单元，作者详细分析了主要的债券衍生品——债券远期、债券期货与债券期权的原理以及应用。

虽然我国债券衍生产品依然处于起步阶段，但随着市场规模的扩大以及避险和金融创新要求的提高，债券衍生品的开发以及运用必不可少。

## <<固定收益证券的估值、定价与计算>>

### 书籍目录

第1章 债券概述 1.1 债券的概念与特征 1.2 中国债券的分类 1.2.1 按照发行人分类 1.2.2 按照票面利率的特点分类 1.2.3 按照价格与面值的关系分类 1.2.4 按照债券契约中是否含有期权条款分类 1.2.5 按照债券期限分类 1.2.6 按照债券存在形态分类 1.3 债券的作用 习题 第2章 中国债券市场结构 2.1 发行市场 2.1.1 承购包销 2.1.2 招标发行 2.1.3 簿记建档 2.2 交易市场 2.2.1 交易所市场 2.2.2 银行间市场 2.2.3 二级市场的交易模式 2.2.4 二级市场的报价——全价与净价 2.3 托管与结算的特点 2.3.1 债券托管 .....第3章 债券价格与债券收益率第4章 债券价格的利率敏感性第5章 无违约风险债券定价第6章 利率期限结构动态模型第7章 含权债券的价格特征与估值问题第8章 公司债券的估值分析第9章 抵押支持债券第10章 债券组合管理第11章 债券风险管理第12章 债券衍生品习题参考答案参考文献后记北师大版经管类高校教材书目(赠教学课件)教师用免费教材样本申请表

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>