

<<债券市场>>

图书基本信息

书名：<<债券市场>>

13位ISBN编号：9787300130811

10位ISBN编号：730013081X

出版时间：2011-1

出版时间：中国人民大学出版社

作者：弗兰克·J·法博齐

页数：785

字数：1099000

译者：路蒙佳

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>

<<债券市场>>

内容概要

本书旨在介绍债券市场产品，提供债券定价分析技术和利率变化时债券风险的量化分析方法，并为实现客户目标提供投资组合策略。

书中首先对债券及债券市场进行了概述，重点介绍了各种债券定价方法和债券收益率的衡量方法。然后对美国债券市场的各个重要组成部分，包括国债市场、政府机构债券市场、市政债券市场、公司债券市场、资产支持证券市场和抵押贷款支持债券市场等逐一进行介绍。

接着结合近年来债券市场上出现的金融创新趋势，对较为复杂的新型债券市场工具，如可转换债券、附有嵌入式期权的债券等的发展及其定价进行了重点介绍。

最后，介绍了债券的信用风险及其分析方法，并讨论了如何利用不同的债券投资策略实现债券组合管理的目标，以及如何衡量和评价债券组合管理者的投资业绩。

本书理论与实务兼具，在写作上由浅入深，并注重前沿问题的研究，使读者既能轻松地学习理论知识，又能了解债券市场的最新发展动态。

<<债券市场>>

作者简介

弗兰克·J·法博齐 (Frank J. Fabozzi)，耶鲁大学管理学院的金融学教授。1972年于纽约城市大学获得经济学博士学位，1977年获得注册金融分析师 (CFA) 资格。他目前担任《投资组合管理杂志》 (the Journal of Portfolio Management) 的主编，曾撰写和编辑了许多广为世人称赞的金融学著作。他的主要研究领域是投资管理和结构性金融。

<<债券市场>>

书籍目录

- 第1章 导论
- 第2章 债券定价
- 第3章 债券收益率的衡量
- 第4章 债券价格的波动性
- 第5章 影响债券收益率和利率期限结构的因素
- 第6章 国债与政府机构证券
- 第7章 公司债务工具
- 第8章 市政债券
- 第9章 非美国债券
- 第10章 住房抵押贷款
- 第11章 政府机构抵押转手证券
- 第12章 政府机构抵押担保债券和剥离式抵押贷款支持证券
- 第13章 非政府机构住房抵押贷款支持证券
- 第14章 商业不动产抵押贷款和商业不动产抵押贷款支持证券
- 第15章 资产支持证券
- 第16章 债务抵押债券
- 第17章 利率模型
- 第18章 附有嵌入式期权债券分析
- 第19章 住房抵押贷款支持证券分析
- 第20章 可转换债券分析
- 第21章 公司债券信用分析
- 第22章 信用风险模型
- 第23章 积极的债券组合管理策略
- 第24章 指数化策略
- 第25章 负债融资策略
- 第26章 债券投资业绩的衡量和评估
- 第27章 利率期货合约
- 第28章 利率期权
- 第29章 利率互换、利率上限和下限
- 第30章 信用衍生工具

<<债券市场>>

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>