

<<固定收益证券定价理论>>

图书基本信息

书名：<<固定收益证券定价理论>>

13位ISBN编号：9787309041354

10位ISBN编号：7309041356

出版时间：2004-10

出版时间：复旦大学出版社

作者：汤震宇

页数：206

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>

## <<固定收益证券定价理论>>

### 前言

21世纪世界经济的发展特征是全球化、数字信息化和金融化。世界金融市场的蓬勃发展产生了对合格金融专业人员的大量需求、对世界金融通行语言和通行标准的需求。

投资人、企业和金融管理层都需要一个统一的、规范的标准来衡量金融分析人员的知识水平、道德规范 and 专业化程度，从而建立起对他们所提供的金融服务和管理金融资产能力的信赖。

伴随着中国加入WTO，我国金融市场国际化的步伐必将进一步加快，因此我们必须按照国际标准来参与竞争，了解、熟悉国际标准，参与制定国际标准，才能在国际市场竞争的过程中处于主动的、有利的地位。

金融从业人员，包括基金经理、证券分析师、财务总监、投资顾问、投资银行家、交易员等等，不仅要严格而全面地掌握系统的金融知识体系，掌握金融投资行业各个核心领域的理论与实践知识，包括从投资组合管理到金融资产估价，从衍生证券到固定收益证券以及定量分析等；而且要积极了解、熟悉国际标准，参加国际金融交流活动，研讨世界金融市场发展的动向，借鉴国外通行的行业标准来规范中国金融市场的发展，这是对中国的金融市场有长远意义的一件大事。

CFA (Chartered Financial Analyst, 注册金融分析师) 是通行于世界的金融分析资格证书，要获取证书不仅要通过严格的三级考试，而且要求持证人遵守必需的职业伦理规范。

由于认证机构注册金融分析师学会 (CFA Institute) 严格地遵从这一准则，所以，CFA证书在全球投资分析和投资管理界享有较高的声誉，从某种程度上来说，CFA代表着在国际投资界和投资管理界的一种通行的高标准。

## <<固定收益证券定价理论>>

### 内容概要

《固定收益证券定价理论》以美国注册金融分析师考试相关内容为核心。采用大量实例以及适当的数学推导对固定收益证券定价理论做了精确又简洁的阐述，并全面归纳总结了固定收益证券定价理论的逻辑体系结构。

《固定收益证券定价理论》语言平实易懂，不需要读者具备很好的数学基础。另外，《固定收益证券定价理论》中以及书后附有英文专业词汇对照，定会为读者在参加全英文的注册金融分析师考试的准备提供帮助。

《固定收益证券定价理论》不仅可以作为注册金融分析师考试的参考书，而且可作为金融从业人员和投资者了解和分析固定收益证券的工具书。

## <<固定收益证券定价理论>>

### 书籍目录

1 货币的时间价值1.1 货币时间价值的计算1.2 TIBA11PLUS计算器使用说明2 固定收益证券特性2.1 固定收益证券的定义和基本特征2.2 固定收益证券的种类2.3 固定收益证券的收益率测度2.4 固定收益证券的风险2.5 美国债券市场3 固定收益证券定价（一）3.1 固定收益证券价格的确定3.2 固定收益证券价格随时间的变化关系3.3 固定收益证券实际市场价格4 固定收益证券定价（二）4.1 不同形状的收益率曲线4.2 利率期限结构4.3 远期利率5 固定收益证券定价（三）5.1 固定收益证券价格波动性的特征5.2 固定收益证券价格波动性的度量6 固定收益证券定价（四）6.1 含权债券定价的一般方法6.2 抵押债券7 固定收益证券投资组合管理一般原理7.1 固定收益证券投资组合管理程序与风险测量7.2 固定收益证券投资组合业绩评价8 固定收益证券投资组合实际应用8.1 基金负债管理8.2 指数型和增强指数型债券组合管理8.3 企业债券投资组合管理的相对价值方法8.4 国际债券投资组合管理8.5 衍生品与利率风险管理8.6 信用衍生品参考文献附录 固定收益证券专业术语中英文对照表

## <<固定收益证券定价理论>>

### 媒体关注与评论

注册金融分析师（CFA）资格考试被称作“全球金融第一考”。CFA是当今世界证券投资与管理界普遍认可的一种职业称号。

目前，中国高级金融人才奇缺，金融分析师更是存在着巨大的供需缺口，越来越多的中国金融从业人员关注和学习CFA的知识体系，每年报考CFA的人数呈递增趋势。

《注册金融分析师系列》丛书的出版将促进最新金融理论和方法的传播，具有实用性、通俗性、创新性特点。

不仅仅是中国参加CFA应试的各级考生辅导丛书，而且对于金融分析人员、投资组合管理人员及有志于在金融领域有所发展的金融爱好者来说，《注册金融分析师系列》有助于他们掌握CFA的知识体系和伦理规范、现代组合管理和投资分析的规范与理念，是了解国际通行做法的一个窗口。

——国务院发展研究中心名誉主任，综合开发研究院（中国·深圳）理事长马洪

<<固定收益证券定价理论>>

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>