

# 资本市场



[资本市场\\_下载链接1](#)

著者:弗兰克·J·法博齐 弗朗哥·莫迪利亚尼

出版者:经济科学出版社

出版时间:1998年01月

装帧:平装

isbn:9787505813496

本书旨在描述当今金融市场上存在的广为应用的融资、投资和控制风险的工具。其既可应用于投资银行课程，又可作为衍生市场课程的补充教材。

作者介绍:

弗兰克·J·法博齐（Frank J. Fabozzi）是耶鲁大学管理学院的金融学副教授和《投资组合管理杂志》（Journal of Portfolio Management）的编辑，1986—1992年间麻省理工学院金融教学组的专职成员。法博齐博士撰写和编辑了许多广为世人称赞的金融学著作。他是黑石封闭式基金和公园道投资组合开放式基金的董事和两家离岸基金的监事。他于1972年在纽约城市大学的研究生中心获得经济学博士学位，并且是一位注册金融分析师（CFA），1994年被诺瓦东南大学授予人文学科名誉博士学位。

弗朗哥·莫迪利亚尼（Franco Modigliani）是麻省理。学院的教授和金融、经济学教授，国际经济协会的名誉主席，美国经济协会。美国金融协会和计量经济协会的前主席。他是许多学会的成员，其中包

括国家科学院。莫迪利亚尼教授撰写了大量经济学和金融学方面的书籍和文章。1985年10月，他被授予诺贝尔经济学奖。曾担任联邦储备体系、美国财政部和许多欧洲银行和公司的顾问，也是许多公司的董事。莫迪利亚尼教授1939年在罗马大学获得了法理学博士学位，1944年在新社会调查学院获得了社会科学博士学位，并获得了其他一些荣誉学位。

目录: 第一章导论  
金融资产\金融市场\衍生市场

第一篇市场参与者  
第二章市场参与者与金融创新概述  
发行者与投资者\金融中介机构的作用\金融机构资产与负债管理概述\金融市场的监管\金融创新  
第三章存款性金融机构  
存款性机构的资产负债问题\商业银行\储蓄贷款协会\储蓄银行\信用合作社  
第四章非存款性机构  
保险公司\养老基金\投资公司  
第五章投资银行  
投资银行的业务范围\业务性质\行业结构\投资银行间的竞争与挑战\对行业的重新估价

第二篇市场组织与结构  
第六章一级市场  
证券发行的管理\证券承销的变种\世界资本市场的一体化及其对筹资的影响\在国外市场筹资的动机  
第七章二级市场  
二级市场的功能\交易场所\市场结构\完善的市场\二级市场的交易机制\经纪人与自营商在现实市场中的作用\市场效率\交易成本\

第三篇风险与收益理论  
第八章风险与收益理论 (一)  
投资收益的度量\证券组合理论\风险资产与无风险资产\证券组合风险的度量\证券组合的预期收益率\分散化\风险资产组合的选择  
第九章风险与收益理论 (二)  
经济学假设\资本市场理论\资产定价模型\多要素资产定价模型\套利定价理论模型\可取的原则

第四篇衍生市场  
第十章金融期货市场导论  
期货合约与远期合约\期货合约的风险与收益特征\期货合约的定价\利用期货进行套头交易的一般原理\期货在金融市场中的作用\通用会计署对金融衍生工具的研究\  
第三篇风险与收益理论  
第八章风险与收益理论 (一)  
投资收益的度量\证券组合理论\风险资产与无风险资产\证券组合风险的度量\证券组合的预期收益率\分散化\风险资产组合的选择  
第九章风险与收益理论 (二)  
经济学假设\资本市场理论\资产定价模型\多要素资产定价模型\套利定价理论模型\可取的原则

第四篇衍生市场  
第十章金融期货市场导论  
期货合约与远期合约\期货合约的风险与收益特征\期货合约的定价\利用期货进行套头交易的一般原理\期货在金融市场中的作用\通用会计署对金融衍生工具的研究  
第十一章期权市场导论  
期权合约\期权合约与期货合约的区别\期权的风险与收益特征\期权定价\期权市场的经

济角色\异型期权  
第十二章互换、上限和下限市场  
互换\上限与下限协议

第五篇股市场  
第十三章普通股票市场  
二级市场\证交会关于股市场结构的研究\机构投资者的交易安排\股票市场指标\定价效率的检验与投资组合策略的含义\1987年的股灾\非美国股市场\欧洲股权  
第十四章股票期权市场  
交易所交易期权的历史\交易所交易股票期权的特点\股票期权的定价模型\期权的投资策略\股票期权市场的定价效率\权证  
第十五章股票指数衍生市场  
股票指数期权\股票指数期权市场的定价效率\股票指数期货市场\股权互换\应用\股票指数合约、股价波动率和黑色星期一

第六篇利率决定和债券估价  
第十六章利率理论与结构  
利率理论\利率结构\内含选择权第十七章债务合约的定价及其价格波动的特征  
债务合约的特征\基本定价原则\债券收益：到期收益率的度量\债券价格变化的原因\溢价——平价的决定因素\现金流的再投资与收益\债券价格的易变性  
第十八章利率的期限结构  
收益率曲线\理论上的即期利率曲线的构建\远期利率\利率期限结构形状的决定因素

第七篇债务市场  
第十九章货币市场  
短期国库券\商业票据\银行承兑票据\大额可转让存单\回购协议\联邦资金  
第二十章财政证券与联邦机构证券市场  
财政证券\联邦机构证券\非美国政府债券市场第二十一章公司债券市场  
公司债券的特征\公司债券评级\事故风险\高收益公司债券市场\二级市场\公司债券的私募市场\公司债券市场的风险与收益\欧洲债券市场  
第二十二章中期票据、银行贷款和优先股市场  
中期票据\银行贷款市场\优先股\破产与债权人的权利  
第二十三章市政证券市场  
市政证券的投资者\市政证券的特点\市政证券的种类\信用风险\税收风险\初级市场\二级市场\市政证券市场的监管\市政证券的收益率  
第二十四章不动产抵押市场  
不动产抵押\投资者\抵押发起人\抵押贷款运作人\抵押贷款承保人\传统抵押贷款\不匹配问题与可调整利率抵押贷款的创立\气球型抵押贷款\倾斜问题与其他抵押工具的产生\抵押贷款的违约风险  
第二十五章抵押转递证券市场  
二级抵押市场的发展\抵押转递证券\抵押转递证券的种类\提前偿付惯例与现金流\影响提前偿付行为的因素\二级市场\与转递证券有关的提前偿付风险\剥离式抵押担保证券  
第二十六章担保抵押债务市场  
顺序偿还档\应计档\浮动利率档\按计划摊销类别档\信用风险\对税收的考虑\当今的担保抵押债务市场第二十七章资产担保证券市场  
资产担保证券的发行者和担保品\资产担保证券的特点\资产证券化的益处及其对金融市场的潜在影响  
第二十八章场内交易的利率期货和期权  
利率期货合同\场内交易的利率期权第二十九章利率衍生工具场外交易市场  
场外交易的利率期权\远期利率协定\利率互换\利率协定

第八篇外汇市场  
第三十章外汇市场  
外汇汇率\外汇风险\现汇市场\交叉汇率\交易商\欧洲货币单位

第三十一章控制外汇汇率的工具  
货币远期合约\货币期货合约\货币期权合约\货币互换  
· · · · · (收起)

[资本市场\\_下载链接1\\_](#)

标签

资本-金融

finance

金融

资本市场

美国

投资

弗朗哥·莫迪格里亚尼

investment

评论

-----  
[资本市场\\_下载链接1\\_](#)

书评

-----  
[资本市场 下载链接1](#)