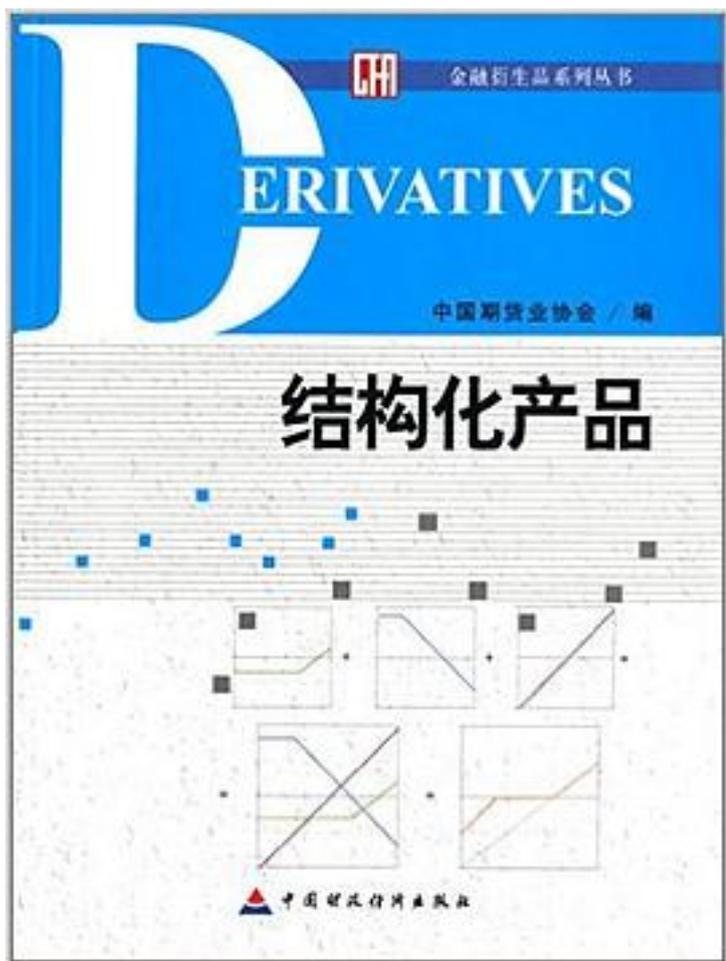


结构化产品



[结构化产品_下载链接1](#)

著者:中国期货业协会

出版者:中国财政经济出版社

出版时间:2013-7-1

装帧:平装

isbn:9787509545461

《结构化产品》由中国财政经济出版社出版。

作者介绍:

目录: 第一章概述

- 一、什么是结构化产品?
- 二、结构化产品的真实例子
- 三、结构化产品的一般特征是什么?
- 四、结构化产品包含哪些种类?
- 五、结构化产品为何如此具有吸引力?
- 六、与结构化产品相关的市场参与者有哪些?
- 七、如何设计一个结构化产品?
- 八、结构化产品可以在二级市场买卖吗?
- 九、结构化产品的市场具有哪些特征?
- 十、结构化产品市场、基础资本市场、普通衍生工具市场三者之间有什么关系?
- 十一、结构化产品市场的发展历史
- 十二、中国的结构化产品市场发展历史和现状是怎样的?

第二章结构化产品中嵌入的奇异期权

- 一、什么是奇异期权?
- 二、结构化产品中嵌入的界限依赖期权
- 三、结构化产品中嵌入的路径依赖期权
- 四、结构化产品中嵌入的多因素期权
- 五、结构化产品中嵌入的修正回报期权

第三章结构化产品的定价与风险评估

- 一、结构化产品定价的一般原理
- 二、结构化产品定价的特殊问题
- 三、创设者和发行者在确定结构化产品初始价格时应该注意哪些问题?
- 四、结构化产品在二级市场买卖时如何合理定价?
- 五、结构化产品的风险评估流程和评估方法?
- 六、评估结构化产品的风险需要特别注意哪些问题?

第四章股权类结构化产品

- 一、从传统到现代的演化——股权类结构化产品的发展历程
- 二、第一类股权类结构化产品——股票联结票据
- 三、股票联结票据的多样化结构
- 四、股票联结票据具有哪些形态?
- 五、可转换债券中存在的结构化特征
- 六、可转换债券对发行者和投资者而言各有何用途?
- 七、可转换优先股中存在的结构化特征
- 八、股票联结票据中的期权部分构件可以设计出什么样的结构?
- 九、不支付利息的股票联结票据——对票面息率和期权部分构件的结构化设计
- 十、相对于可转换债券, 现代股票联结票据的转股条款(期权部分构件) 有哪些变化?
- 十一、以第三方股票为标的物的股票联结票据——对期权部分标的物的结构化设计
- 十二、第二类股权类结构化产品——股指联结票据
- 十三、投资者可以用股指联结票据干些什么?
- 十四、股指联结票据中的多样化结构
- 十五、股指联结票据中的结构之一: 收益增强构造
- 十六、股指联结票据中的结构之二: 本金保护构造
- 十七、股指联结票据中的结构之三: 有效分散投资构造
- 十八、如何评估和管理股权类结构化产品的风险?

第五章利率类结构化产品

- 一、利率类结构化产品有哪些主要类型?
- 二、中国金融市场中利率类结构化产品的现状
- 三、第一类利率类结构化产品——利率联结票据
- 四、支付浮动利息的利率类结构化产品

五、第二类利率类结构化产品——以固定期限国债或互换协议利率为标的物的利率类结构化产品

六、固定期限国债利率和固定期限互换协议利率及其衍生工具

七、第三类利率类结构化产品——指数分期偿还债券

八、第四类利率类结构化产品——可赎回债券和可售回债券

九、可赎回债券具有哪些用途？

十、一种管理利率风险和套利的策略——组合运用可赎回债券和利率互换期权

十一、可赎回债券还可以演化出哪些结构变化？

十二、普通债券和期权进行可赎回债券的合成

十三、可赎回债券的镜像结构——可售回债券所具有的结构特征

十四、第五类利率类结构化产品——债券认购权证

十五、如何为利率类结构化产品定价？

第六章信用类结构化产品

一、信用衍生工具——信用类结构化产品的基石

二、信用类结构化产品有哪些主要类型？

三、中国金融市场中的信用衍生工具和信用类结构化产品

四、第一类信用类结构化产品——各种类型的信用联结结构化票据及其结构化特征

五、第二类信用类结构化产品——重新包装信用联结票据及其结构化特征

六、第三类信用类结构化产品——合成债券及其结构化特征

七、第四类信用类结构化产品——担保债务凭证

八、担保债务凭证具有哪些结构特征？

九、怎样对担保债务凭证进行评级？

十、如何运用各种不同结构类型的担保债务凭证？

十一、我国金融市场中的担保债务凭证

第七章汇率类结构化产品

一、汇率类结构化产品有哪些主要类型？

二、第一类汇率类结构化产品——双货币票据及其结构特征

三、双货币票据如何满足投资者的投资需求？

四、发行人如何对双货币票据进行定价和风险对冲？

五、第二类汇率类结构化产品——以指数货币期权票据（ICON）为代表的货币联结票据

六、基于ICON的结构特征可以做哪些新的变化？

七、除了ICON之外，货币联结票据还有哪些发展形态？

八、中国金融市场中汇率类结构化产品的现状及其类型

第八章商品类结构化产品

一、为什么要投资商品及创立商品类的结构化产品？

二、商品类结构化产品的主要类型及其结构特征

三、基于商品的融资交易

四、商品挂钩的结构化票据

五、金融市场中有哪些著名的用于结构化产品设计的大宗商品价格指数？

六、中国金融市场有哪些商品类结构化产品？

参考文献

后记

• • • • • [\(收起\)](#)

[结构化产品_下载链接1](#)

标签

金融工程

金融

金融衍生品

资本市场

评论

这一本拖了好久的。这一本和场外衍生品得最后读，不过结构化的思想很美妙，收益增强本金保护，债权类股权类信用类商品类，既需要广博的知识也需要相当好的数理基础。应该是相对前沿的知识了，也许是最实用的，也是衍生品的归宿所在。

看完了!

这本写的太难读了，也许是因为之前接触这方面的知识比较少。全书的基本结构就是总分的形式，先介绍结构化产品，然后展开讲股权、利率、信用等的结构化产品，沿著概念、品种、定价、对冲的线索一一展开。许多时候下的定义让人有点摸不着头脑，讲的还没有百科容易理解，很多地方没有看透，还有许多地方没有弄明白的，哎，再接再厉吧，还有很长的路要走。

错误多

有很多复杂的结构化产品，核心就是把结构化产品拆成固定收益债券和期权，那就是说把金融期权和固定收益证券学好了，结构化产品就能学好

这本书写的蛮糟糕的，不过作为介绍性产品，有总比没有好吧。

[结构化产品_下载链接1](#)

书评

[结构化产品_下载链接1](#)