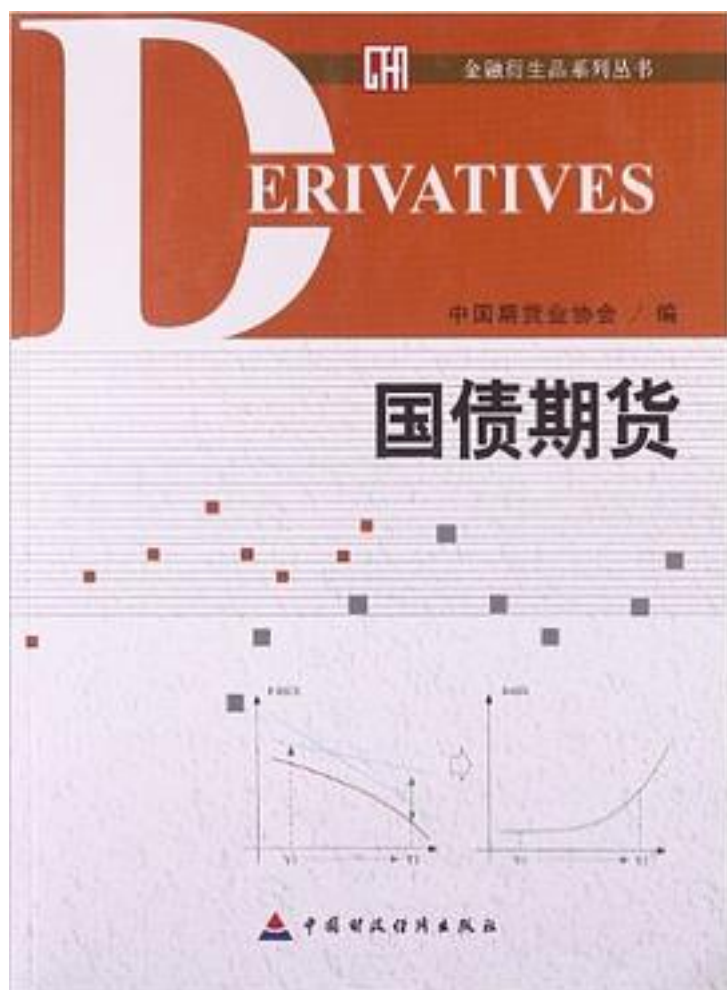


国债期货



[国债期货_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:2013-6-1

装帧:平装

isbn:9787509545386

《金融衍生品系列丛书:国债期货》也可以作为期货从业人员和专业投资者的参考书。

作者介绍:

目录: 第一章利率与债券

- 一、什么是债券?
- 二、什么是利率? 利率与债券的关系是什么?
- 三、利率有哪些分类?
- 四、什么是利率的期限结构?
- 五、债券收益率与价格是什么关系?
- 六、什么是全价? 什么是净价? 什么是应计利息?
- 七、什么是债券久期、凸性?
- 八、什么是债券基点价值?
- 九、债券交易有哪些风险?
- 十、在哪里进行债券交易?
- 十一、与利率相关的金融产品有哪些?
- 十二、我国债券市场的发展历史
- 十三、我国债券市场的现状
- 十四、我国债券市场有哪些交易品种?

第二章国债与国债期货

- 一、经济发达国家的国债市场是怎样的?
- 二、国债期货是如何发展起来的?
- 三、国债期货的主要交易品种有哪些?
- 四、国债期货的市场规模有多大?
- 五、国债期货有哪些参与者?
- 六、国债期货有哪些参与方式?
- 七、国债期货的标的物是什么?
- 八、什么是转换因子?
- 九、什么是持有期损益?
- 十、什么是最便宜可交割券 (CTD) ?
- 十一、什么是基差? 什么是净基差?
- 十二、什么是净基差 (BNOC) 法? 如何利用BNOC找到CTD?
- 十三、什么是隐含回购率 (IRR) 法? 如何利用IRR找到CTD?
- 十四、什么是经验法则法? 如何利用经验法则找到CTD?
- 十五、国债期货如何定价?
- 十六、如何计算国债期货的久期?
- 十七、如何计算国债期货的基点价值?
- 十八、什么是国债收益率曲线? 收益率曲线和国债期货有什么关系?

第三章我国国债期货合约解读一

- 一、国债期货合约有哪些内容?
- 二、国际主要国债期货合约的比较
- 三、国债期货上市需要哪些条件, 利率市场化是否是其必要条件?
- 四、国债期货如何收取保证金?
- 五、国债期货为什么要设涨跌停板制度
- 六、如何进行国债期货的每日结算?
- 七、什么是国债期货的持仓限额?
- 八、什么是强制平仓与强制减仓制度?
- 九、国债期货如何交割?
- 十、如何确定交割结算价?
- 十一、哪些国债可以参与交割?
- 十二、交割时如何选择交割券?
- 十三、交割时国债价格如何确定? 交割违约如何处理?

第四章国债投机交易

- 一、国债期货的投机交易

- 二、如何分析国债期货走势？
- 三、如何制定投机交易策略和计划？
- 四、投机交易有哪些风险？
- 五、制定投机交易策略流程实例分析
- 第五章国债期货的基差交易
- 一、什么是国债基差交易？
- 二、基差交易与套利交易的关系是怎样的？
- 三、基差空头交易存在哪些困难？
- 四、基差交易进入交割环节时，头寸如何调整？其损益如何计算？
- 五、为什么说国债基差交易中隐含了期权？
- 六、基差交易中隐含的期权与真正期权有哪些不同点
- 七、如何计算基差多头交易的损益？使用不同的现货操作，会有什么不同？
- 八、如何通过做多基差获利？
- 九、如何计算基差空头交易的损益？使用不同的现货操作，会有什么不同？
- 十、如何通过做空基差获利？
- 十一、如何进行基差无风险套利？
- 十二、资金不足时如何进行基差交易？
- 十三、基差交易有哪些风险？
- 第六章国债期货的套期保值
- 一、什么是国债套期保值？
- 二、如何计算套保比例？
- 三、如何评估套保效果？套期保值和基差交易有什么区别？套期保值的损益曲线是怎样的？
- 四、如何动态调整套保比例？对套保效果有什么影响？
- 五、如何进行多头套保？如何计算多头套保的损益？
- 六、国债套期保值面临哪些风险？
- 第七章国债期货在资产配置中的应用
- 一、国债期货在资产配置中的作用有哪些？
- 二、如何利用国债期货管理现货的久期和基点价值？
- 三、如何通过国债期货进行资产配置与指数化投资？
- 第八章机构投资者如何使用国债期货
- 一、国债期货的参与者有哪些？
- 二、银行业如何使用国债期货？
- 三、保险公司如何利用国债期货？
- 四、券商如何使用国债期货？
- 五、基金如何使用国债期货？
- 六、其他金融机构如何利用国债期货？
- 第九章国债期货交易的风险管理
- 一、国债期货投资有何风险？
- 二、投资中需关注的交易所风险控制措施有哪些？
- 三、风云突变“327”，国债期货为何戛然而止？
- 四、“327国债事件”是否会重演？
- 五、如何选择代理库交易的期货公司？
- 六、投资交易中如何管理资金？
- 七、如何设置止盈止损位？
- 八、美国1986年国债期货逼空事件有哪些启示？
- 第十章国债期货与其他金融衍生品
- 一、国债期货与股指期货交易方式有何区别？
- 二、什么是利率互换？
- 三、什么是国债期权？
- 四、什么是短期利率期货？
- 五、什么是信用违约互换（CDS）？
- 六、什么是债券基金和债券ETF？
- 参考文献

后记
· · · · · (收起)

[国债期货_下载链接1](#)

标签

期货

金融衍生品

国债

金融

利率

债券

金融工程

经济学

评论

中国期货业协会出的这套书真的比教材要良心，是真的打算正儿八经教读者一些东西的，很细致，不故弄玄虚，行文也不枯燥程式化，是认真编写过的。如果想细致了解国债期货的每件事情，读这本书算是个好的开始。后半部分有些知识点还是有难度的。

国债期货入门最佳，与配套的股指期货。真是良心啊

有点难度

有点复杂。和3%比较，计算ctd和基差交易，转换因子和基点价值。

内容全面所以解释起来无法面面俱到，让强迫症有点难受。果然是需要有钻研精神才行。
。

国债期货方面讲的很细致，但是国债期货定价那个例题好像不太对，结合陈蓉的固收的看感觉效果不错

[国债期货 下载链接1](#)

书评

[国债期货 下载链接1](#)