

# 固定收益证券



[固定收益证券\\_下载链接1](#)

著者:陈蓉

出版者:北京大学出版社

出版时间:2011-9

装帧:平装

isbn:9787301156322

《固定收益证券》是一本关于固定收益证券定价和利率风险管理的教材，涵盖固定收益证券领域的传统知识与最新发展。《固定收益证券》分为三大部分:第一章对固定收益证券和国内外市场现状进行了概述;第二章至第六章为初级部分;包括基本固定收益证券的分析与定价、静态利率期限结构模型、初级利率风险管理技术和固定收益证券资产组合管理策略;第七章至第九章为高级部分。详细介绍了利率期限结构动态模型、利率期权定价方法和高级利率风险管理技术,其中对利率期限结构的静态主成分分析、因子分析、曲线拟合技术、动态利率模型原理和运用的详细介绍是本教材的最大特色。全书强调知识的应用性,强调理论模型的严谨性,配有大量丰富且贴近观实的案例,注重市场直觉的培养,力求为读者提供易于理解和可直接应用的知识 and 工具。

《固定收益证券》可作为普通高等院校金融学、金融工程等专业“固定收益证券”课程本科生和研究生的教科书,还可作为金融机构从业人员的培训教材及相关领域研究人员、行业监管人员的参考书。

作者介绍:

陈蓉,经济学(金融学)博士,厦门大学金融系金融工程教授、博士生导师,美国康奈尔大学金融计量与金融工程方向博士后,曾赴美国北卡罗来纳大学夏洛特分校数学与统计学系访问并授课。先后发表了20多篇学术论文,出版了近10部著作和教材,作为主持人和主要参与者承担了6项国家和省部科研课题的研究,主持了7项横向课题,并多次

获奖。近年来的研究领域包括：金融工程、固定收益证券、风险管理与金融计量。

郑振龙，厦门大学金融学国家重点学科学术带头人、经济学（金融学）博士、金融工程教授、博士生导师。国务院学科评议组成员、国务院政府特殊津贴专家、闽江学者特聘教授。曾以富布赖特研究学者身份留学美国加州大学洛杉矶分校（UCLA）、以高级研究学者身份留学英国伦敦经济学院（LSE）。

目录: 第一章 固定收益证券概述

- 第一节 理解固定收益证券
- 第二节 基础性债务工具
- 第三节 固定收益证券衍生品
- 第四节 结构性债务工具
- 第五节 固定收益证券市场

第二章 债券价格与收益率

- 第一节 货币的时间价值
- 第二节 利率
- 第三节 债券定价
- 第四节 债券的收益率分析
- 第五节 债券的报价 附录

第三章 利率远期、利率期货与利率互换

- 第一节 利率远期
- 第二节 利率期货
- 第三节 利率互换

第四章 利率期限结构：静态模型

- 第一节 利率期限结构概述
- 第二节 利率期限结构变动的因子分析
- 第三节 传统的利率期限结构理论
- 第四节 利率期限结构的拟合 附录

第五章 利率风险管理

- 第一节 利率风险的度量
- 第二节 基于久期和凸性的利率风险管理

第六章 固定收益证券组合管理

- 第一节 保守的组合管理策略
- 第二节 积极的组合管理策略
- 第三节 对冲型组合管理策略 附录：中债指数编制说明

第七章 利率期限结构：动态模型

- 第一节 动态利率模型概述
- 第二节 仿射利率期限结构模型
- 第三节 hjm分析框架与无套利模型
- 第四节 动态利率模型参数的估计与校准 附录

第八章 利率期权定价

- 第一节 债券期权
- 第二节 可赎回与可回售债券
- 第三节 利率顶和利率底
- 第四节 利率互换期权

第九章 高级利率风险管理

- 第一节 期权调整利差分析法
- 第二节 在险值

参考文献

• • • • • [\(收起\)](#)

## 标签

金融

固定收益

研究方法

债券

2018

## 评论

案头常备蓉姐的书

-----  
入门，偏于理论概念介绍，也穿插国内情况，公式推导这些较少。

-----  
前两章mark, 学习了基础的名词与概念

-----  
我是专门为了青春美丽温柔动人讲课思路清晰语言平实的陈蓉老师而来打分的！>3

-----  
偏金融工程的固定收益证券教材。

-----

一年前初读太晦涩 有些知识储备后发现写的是真好

-----  
我不敢不给高分 因为我看得不明觉厉 微博知乎朋友圈都卸了 只有豆瓣能吐槽  
写的很清楚 逻辑分明 但是我运算无能 什么久期 什么凸性 美元久期 美元凸性  
计算公式再长一点你敢不敢 高考过去这么久 求二阶导技能基本丧失 我只想做个文科生  
无奈研究生还特么要学衍生品 啊啊啊 嗯加两句:久期和凸性的公式还挺好理解的

-----  
不少地方语焉不详

-----  
蓉姐的书，讲的简洁明了，读起来很舒服我觉得比法博奇的书要好

-----  
不错的教材

-----  
这么经典居然没人评

-----  
[固定收益证券\\_下载链接1](#)

## 书评

这本书是我在固定收益部门实习时经理推荐给我的。两个作者是厦大非常出名的金融类老师，整本书编排得很不错，内容基本也都覆盖到了。  
对于刚学习金融类基础知识的我，就是要恶补一下金融类衍生品的。其中关于金融类衍生品的，因为不是重点，主要是简短介绍。数学部分，对于我...

-----  
[固定收益证券\\_下载链接1](#)