

《固定收益投资工具》

图书基本信息

书名：《固定收益投资工具》

13位ISBN编号：9787508647319

出版时间：2015-5

作者：弗兰克·J·法博齐

页数：448

译者：传神

版权说明：本站所提供下载的PDF图书仅提供预览和简介以及在线试读，请支持正版图书。

更多资源请访问：www.tushu111.com

《固定收益投资工具》

内容概要

《固定收益投资工具》是著名教授弗兰克·J·法博齐带领团队编写的金融手册系列之一。

《固定收益投资工具》所涵盖的固定收益产品最广、最全，它向金融专业人士全面介绍了各种类型的固定收益投资工具。

固定收益投资工具有别于股票市场，顾名思义，收益固定，常见的投资工具有债券、住房抵押贷款、反向抵押贷款、市政债券、欧洲债券、商业票据、可转换债券、银团贷款、巨灾证券等，这些都将在本书中进行详细说明。

《固定收益投资工具》

作者简介

弗兰克·J·法博齐：博士，注册金融分析师，注册会计师，是耶鲁大学管理学院弗雷德里克·弗兰克金融学副教授。在进入耶鲁大学之前，他是美国麻省理工学院斯隆管理学院的金融学客座教授。法博齐教授是耶鲁大学国际金融中心的会员，同时还是《投资组合管理期刊》的编辑。1972年，他在纽约城市大学获得经济学博士学位。1994年，他被诺瓦东南大学授予名誉博士学位。2002年，被推荐为固定收益分析师协会名人堂。现在，他是中国资产证券化网站的名誉顾问。

《固定收益投资工具》

书籍目录

第一部分 基础

第1章 债券：投资特征和风险

债券市场组成

债券特征

收益衡量

与债券投资相关的风险

第2章 住房抵押贷款

抵押贷款概述

抵押贷款的运作方法

抵押贷款和抵押产品的相关风险

第3章 反向抵押贷款

反向抵押贷款的原理

项目

第二部分 非抵押类固定收益证券与货币市场工具

第4章 美国国债

适销国债的种类

国债拍卖程序

二级市场

第5章 联邦机构证券

联邦政府相关机构

第6章 市政债券

发行人与发行程序

免税与应纳税市政债券

受纳税规定影响的市政债券

市政债券的种类

市政债券收益

浮动利率市政债券

投资市政债券的相关风险

第7章 企业固定收益证券

公司债券

中期票据

优先股

第8章 欧洲债券市场

欧洲债券

外国债券

欧洲债券工具

发行程序：市场参与者

承销费用、费用以及定价

发行债券

贷款保证契约

信托业务

债券形式

清算系统

二级市场

法律和税务问题

欧洲债券和掉期交易

交割129

第9章 欧洲政府公债市场

欧元区：增长最快的国债市场

欧洲政府债券初级市场

二级市场和欧元价差因素

第10章 德国潘德布雷夫债券市场和欧洲担保债券市场

潘德布雷夫债券市场

潘德布雷夫债券的发展史

投资者的典型特征

市场工具

担保债券与资产支持证券或抵押贷款支持证券的关键区别

市场上的参与者

潘德布雷夫债券的信用评级方法

欧洲的担保债券市场

第11章 商业票据

商业票据的特点

商业票据的信用评级

资产支持商业票据

第12章 货币市场运算

天数计算惯例

贴现债券

到期利息的计算方法

第13章 可转换债券

可转换债券市场

可转换债券的一般特征

分析可转换债券：传统方法

其他可转换债券形式

可转换债券套利

第14章 银团贷款

银团贷款概述

银团发展进程

公开市场与私募市场

信用风险：概述

银团贷款融资

为初级市场的贷款定价

按市值计价的影响

银团贷款的类型

第二留置权贷款

低门槛贷款

借款人头衔

二级销售

衍生工具——贷款信用违约互换

定价条款

条款

强制性预付款

抵押物

第15章 新兴市场债券

新兴市场债券工具

主权信用分析

第三部分 结构化产品

第16章 抵押贷款证券概论

创建不同类型的抵押贷款证券

抵押贷款交易

现金流结构化

第17章 构建担保债券与利息债券/本金债券

CMO的非现金流特性

担保债券规则

本金支付类型

利息支付类型

序列债券

分期债券

定期债券

连续的本金债券和其他债券

利息债券和本金债券

高级 / 次级结构

第18章 商业不动产抵押贷款证券2

传统的（现金）商业不动产抵押贷款证券的投资属性

基本商业贷款和商业不动产抵押贷款证券的交易结构

商业不动产抵押品的风险特征

商业不动产抵押贷款证券结构的细微差别

第19章 非抵押资产支持证券

信用卡应收款支持型证券

启动早期分期偿还

汽车贷款支持证券

学生贷款资产支持证券

小型企业管理局贷款担保证券

飞机租赁支持证券

特许经营贷款支持证券

降息债券

第20章 合成资产支持证券

信贷衍生品和ABS市场

付费CDS301

市场因素

信用违约互换和现金债券估算

第21章 巨灾债券

巨灾风险管理

资本市场发展

等级评定机构和建模因素

市场发展

市场参与

第22章 担保债务凭证

担保债务凭证概览

现金流转CDO

合成型套利CDO

第四部分 固定收益和通货膨胀衍生品

第23章 利率期货和远期利率协议

短期利率期货合约

长期利率期货合约

远期利率协议

第24章 利率掉期

普通利率掉期

利率掉期的风险收益特征

掉期头寸

掉期的交易方

其他掉期产品

第25章 利率期权及相关产品

基本的期权合同

场内交易期权和场外交易期权

期货期权

场外交易（OTC）利率期权

复合期权

上限和下限（期权）

上限期权

第26章 信贷衍生工具概览

衍生品：信贷衍生工具的基石

资产证券化：信贷衍生工具的另一块基石

信贷衍生工具的含义

信贷衍生工具的基本原理

衍生工具类型简介

信用联结票据

信用利差期权

信贷衍生工具和传统金融保障产品

信贷衍生工具和证券化

第27章 固定收入总收益互换

总收益互换的基本常识

总收益互换的应用

总收益指数互换

第五部分 债券市场

第28章 债券市场透明度

开放系统的好处

市场定价的非一致性

购买方谨记：所有的价格都不是天生均等

对价格透明度的争论

迅速发展的市场

第29章 债券价差和相对价值

债券价差

资产掉期CDS价格

第30章 互换利差的决定因素与LIBOR期限溢酬介绍

互换利差的决定性因素

期限溢酬等级

宏观层次经济观察以及影响互换利差的政治因素

《固定收益投资工具》

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:www.tushu111.com