

十六. 课程名称：债券市场分析与投资策略

时间:6-12 小时

课程大纲

1. 债券市场概要

金融体系与金融市场

排媒现象

美国债券市场概况

国内债券市场及其发展历程

未来发展趋势

2. 债券的主要分类

利率债券

信用债券

固定与浮动利率债券

3. 可转换债券及其交易

发行可转债的目的

转换期权及其定价

可转债的交易特点

国内可转债案例分析

4.资产证券化

美国 MBS 及其特点

美国 CDS 及其特点

次贷危机

国内资产证券化实践

案例分析

5.债券估值分析

现金流贴现估值模型

债券估值案例分析

6.久期计算与分析

以 excel 表计算久期

久期与债券投资策略

7.债券利率风险结构

违约风险

信用评级

风险与收益率

8.债券利率期限结构

通胀与利率

从历史数据看期限结构

一般状态下的收益率曲线

异型收益率曲线解读

9.当前利率趋势分析

世界与中国经济数据分析

世界利率走势分析

中国利率走势分析

10.中国经济与债券市场风险

中国经济增长潜力分析

供给侧改革

债券市场风险分析

11.债券市场投资策略

道氏理论与市场趋势

长线投资策略

分散化投资策略

二八定律

行为金融理论