
《商业银行债券投资策略与风险控制》

主讲：马老师 约 6 小时

一、债券基本知识和类型

- 1、债券价值分析
- 2、债券分类——按发行主体分
- 3、债券的发行主体
- 4、债券投资主体

二、中国债券市场发展概述

- 1、人民币债券市场的构成
- 2、银行间债券市场发展概述
- 3、银行间债券市场组织架构

三、金融机构如何开展债券业务

- 1、货币市场业务品种
 - (1) 公开市场
 - (2) 拆借市场
 - (3) 回购市场
 - (4) 同业存单
 - 2、农信为何要做债券？
 - 3、本币债券市场分析框架
 - (1) 债券收益率影响因素
 - (2) 债券交易风险分析
 - (3) 信用风险分析
 - 4、债券投资委外业务与机构选择
- ## 四、债券交易结算流程与内控机制

- 1、前期准备
 - (1) 相关机构
 - (2) 准入流程

(3) 交易与结算系统交易品种

(4) 结算方式 (DVP)

2、流程与内控

(1) 债券交易程序

(2) 债券结算程序

(3) 相关内控

3、典型案例分析：

(1) 质押式回购

(2) 买断式回购

(3) 现券买卖

(4) 债券借贷