

Spis treści

Przedmowa	XXXI
ROZDZIAŁ PIERWSZY: Wprowadzenie	1
ROZDZIAŁ DRUGI: Wycena obligacji	15
ROZDZIAŁ TRZECI: Obliczanie stopy zwrotu	41
ROZDZIAŁ CZWARTY: Zmienność cen obligacji	67
ROZDZIAŁ PIĄTY: Czynniki wpływające na stopę zwrotu z obligacji i strukturę czasową stóp procentowych	99
ROZDZIAŁ SZÓSTY: Rynek skarbowych papierów wartościowych i instrumentów emitowanych przez agencje federalne	133
ROZDZIAŁ SIÓDMY: Instrumenty emitowane przez przedsiębiorstwa	165

ROZDZIAŁ ÓSMY: Obligacje komunalne	205
ROZDZIAŁ DZIEWIĄTY: Obligacje nieamerykańskie	235
ROZDZIAŁ DZIESIĄTY: Pożyczki hipoteczne	267
ROZDZIAŁ JEDENASTY: Hipoteczne listy zastawne	293
ROZDZIAŁ DWUNASTY: Obligacje i noty hipoteczne	331
ROZDZIAŁ TRZYNASTY: Certyfikaty pożyczkowe	371
ROZDZIAŁ CZTERNASTY: Analiza obligacji z opcjami dodatkowymi	381
ROZDZIAŁ PIĘTNASTY: Analiza instrumentów hipotecznych	417
ROZDZIAŁ SZESNASTY: Analiza obligacji zamiennych	449
ROZDZIAŁ SIEDEMNASTY: Strategie aktywnego zarządzania portfelem obligacji	465
ROZDZIAŁ OSIEMNASTY: Strategia indeksowania	499
ROZDZIAŁ DZIEWIĘTNASTY: Strategie finansowania zobowiązań	519
ROZDZIAŁ DWUDZIESTY: Pomiar i ocena wyników zarządzania portfelem obligacji	561

ROZDZIAŁ DWUDZIESTY PIERWSZY:	
Kontrakty terminowe na stopy procentowe	587
ROZDZIAŁ DWUDZIESTY DRUGI:	
Opcje na stopy procentowe	625
ROZDZIAŁ DWUDZIESTY TRZECI:	
Swapy procentowe	675
Skorowidz	709
Skorowidz nazwisk	729
Słownik ważniejszych terminów	733