

科学理性与科学方法

巨灾风险债券的利率敏感性研究——基于长江流域大洪灾风险债券的分析

田玲,张岳

武汉大学经济与管理学院,武汉大学经济与管理学院 湖北武汉430072,湖北武汉430072

收稿日期 修回日期 网络版发布日期 接受日期

摘要 通过探讨本金和利息保证比例对长江流域大洪灾风险债券久期和价格利率弹性的影响,分析了巨灾风险债券需求的一个重要影响因素——投资者资产负债的期限匹配因素,得出结论:巨灾风险债券与同期限普通债券相比久期较短,在利率预期上升的情况下,是良好的投资选择。

关键词 [巨灾风险债券](#) [利率敏感性](#) [资产负债管理](#)

分类号

DOI:

对应的英文版文章: [2007-08-054](#)

通讯作者:

田玲

作者个人主页: 田玲;张岳

扩展功能

本文信息

▶ [Supporting info](#)

▶ [\[PDF全文\]](#) (211KB)

▶ [\[HTML\]](#) (OKB)

▶ [参考文献\[PDF\]](#)

▶ [参考文献](#)

服务与反馈

▶ [把本文推荐给朋友](#)

▶ [加入我的书架](#)

▶ [加入引用管理器](#)

▶ [引用本文](#)

▶ [Email Alert](#)

▶ [文章反馈](#)

▶ [浏览反馈信息](#)

相关信息

▶ [本刊中 包含“巨灾风险债券”的相关文章](#)

▶ 本文作者相关文章

· [田玲](#)

· [张岳](#)

