

<<固定收益证券>>

图书基本信息

<<固定收益证券>>

内容概要

本书的主要内容是对暴露在利率风险下的固定收益证券定价和套期保值的现代方法的最新发展进行总结。

以动态模型为基础的现代金融理论，为如何对固定收益证券进行定价和套期保值的研究提供了大量的新的研究方法和思路，使得该领域目前的研究水平远远超出了利用利率风险管理标准静态方法所能达到的研究广度与深度。

<<固定收益证券>>

书籍目录

前言

致谢

标准符号

第1部分 确写性现金流的定价和套期保值

第1章 推导现行零息票债券的收益曲线

第2章 基础资产的定价和套期保值

第2部分 对非确定性现金流进行定价和套期保值

第3章 将零息票债券收益曲线建成动态模型

第4章 对固定收益证券衍生品进行定价和套期保值

第3部分 数学附录

附录A 介绍连续时间随机过程的有关理论知识

附录B 数值方法

关键词索引

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:<http://www.tushu007.com>