

<<结构性金融衍生产品定价研究>>

图书基本信息

书名：<<结构性金融衍生产品定价研究>>

13位ISBN编号：9787505876484

10位ISBN编号：7505876481

出版时间：2008-12

出版时间：经济科学出版社

作者：李畅

页数：123

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>

## <<结构性金融衍生产品定价研究>>

### 内容概要

衍生产品的定价问题是衍生品研究的难点，也是衍生品问题的核心。

本书首先分析了结构性产品的产品构成和设计特点，然后运用金融工程的无套利均衡分析方法，对结构性产品的估值原则、影响定价的因素、发行定价和二级市场定价、定价模型和技术进行了系统、深入的分析研究。

定量分析是衍生品定价研究的基本方法。

本书以中信银行和中国银行发行的两个与金价挂钩的“区间触发”型外币理财产品为例，运用GARCH模型和Monte Carlo模拟，以现代期权定价理论为基础，具体研究了两种产品的定价方法、收益特点、两个产品的价格差别及价格差别的来源。

同时，以中国银行发行的“汇聚宝”系列外币理财产品和光大银行发行的“阳光理财A计划”（2004～2006年区间）系列外币理财产品为例，对此类结构性产品的定价绩效进行了定量研究。

通过对不同类型、不同期限、不同信用等级产品定价的比较，分析了流动性溢价、信用利差、风险溢价在产品定价中的体现和比重。

<<结构性金融衍生产品定价研究>>

作者简介

李畅，女，1971年生，河南汝南人。  
现为同济大学经济与管理学院博士研究生；同济大学金融衍生品研究所研究员。  
在主要研究领域发表论文十余篇，参编教材和专著多部，参与多项国家级和省部级科研课题。  
目前主要研究方向为金融工程。

## <<结构性金融衍生产品定价研究>>

### 书籍目录

第1章 导论1.1 研究的背景与意义1.1.1 国际市场1.1.2 国内市场1.1.3 研究意义与价值1.2 基本研究思路与框架1.3 研究方法1.4 主要创新与不足之处1.4.1 主要创新1.4.2 不足之处第2章 研究综述2.1 国外的研究2.1.1 典型结构性产品的定价研究2.1.2 其他产品的研究2.2 国内的研究

## <<结构性金融衍生产品定价研究>>

### 编辑推荐

《结构性金融衍生产品定价研究》首先分析了结构性产品的产品构成和设计特点，再根据金融工程的无套利均衡分析方法，对结构性产品的估值原则、影响定价的因素、发行定价和二级市场定价、定价模型和技术进行了系统、深入的分析研究。

衍生产品的定价问题是衍生品研究的难点，也是衍生品问题的核心，结构性产品的定价无论对于发行者还是对于投资来说，都具有非常重要的研究意义。

<<结构性金融衍生产品定价研究>>

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>