

<<基于非参数估计的权证定价方 >

图书基本信息

书名：<<基于非参数估计的权证定价方法研究>>

13位ISBN编号：9787515625263

10位ISBN编号：7515625260

出版时间：2013-7-1

出版时间：中国经济出版社

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>

## <<基于非参数估计的权证定价方 >

### 内容概要

《基于非参数估计的权证定价方法研究》给出了权证发行后到期日权证价值的求解算法。并采用应用研究证明了该方法的有效性和精确性，并采用极大似然估计法对权证定价模型所需的未知参数进行有效的估计，并证明估计量的有效性，进一步求出估计量的收敛速度。

## 作者简介

樊鹏英，女，1985年12月出生，山西忻州人，中国科学院数学与系统科学研究院管理学博士，现任北京工商大学经济学院金融系讲师，主要研究方向为金融衍生品定价、贷款违约概率与违约损失率的研究，主要讲授课程有《金融工程》《金融衍生工具》《金融学》。近年来在《系统工程理论与实践》《数理统计与管理》《管理评论》等国家权威期刊以及风险管理与金融系统工程国际学术研讨会上发表论文数篇。2013年，作为项目主持人参与北京工商大学青年教师科研启动基金项目。

书籍目录

- 前言
- 第1章 绪论
  - 1.1 研究背景及研究意义
    - 1.1.1 权证发展历史综述
    - 1.1.2 研究背景
    - 1.1.3 研究意义
  - 1.2 国内外权证定价文献综述
    - 1.2.1 国外文献
    - 1.2.2 国内文献
  - 1.3 研究内容与研究目标
    - 1.3.1 研究内容
    - 1.3.2 研究目标
  - 1.4 研究方法、结构和创新点
    - 1.4.1 研究方法
    - 1.4.2 研究结构
- 第2章 权证基本知识及其定价方法
  - 2.1 权证基本概念
  - 2.2 权证价值及影响因素分析
  - 2.3 权证定价理论
- 基于非参数估计的权证定价方法研究
  - 2.3.1 权证参数定价模型
  - 2.3.2 权证费参数定价模型
- 第3章 完全非参数权证定价方法
  - 3.1 引言
  - 3.2 非参数回归方法介绍
    - 3.2.1 非参数回归基本知识介绍
    - 3.2.2 局部线性估计方法
    - 3.2.3 8样条估计方法
  - 3.3 完全非参数权证定价方法
  - 3.4 实证结果
    - 3.4.1 数据资料
    - 3.4.2 中国内地权证市场价格定价分析
    - 3.4.3 中国香港权证市场价格定价分析
    - 3.4.4 结果分析
- 第4章 基于参数模型的非参数修正权证定价研究
  - 4.1 引言
  - 4.2 基于参数模型的非参数修正定价模型
  - 4.3 实证分析
    - 4.3.1 中国内地权证市场实证结果
    - 4.3.2 中国香港权证市场实证结果
    - 4.3.3 结果分析
- 第5章 稀释效应下的基于非参数估计的中国内地市场权证定价
  - 5.1 引言
  - 5.2 稀释效应下的非参数修正定价方法介绍
    - 5.2.1 稀释效应下的Ad hoc BS模型

5.2.2基于稀释效应Ad hoe BS模型的非参数估计定价方法

5.3实证分析

5.3.1时间内权证价格定价分析

5.3.2时间外权证价格预报分析

5.3.2结果分析

第6章结论与展望

6.1 本书结论

6.2需要进一步研究的问题

参考文献

附录

重要术语索引表

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>