

<<利率模型与应用研究>>

图书基本信息

书名：<<利率模型与应用研究>>

13位ISBN编号：9787564501860

10位ISBN编号：7564501863

出版时间：2011-6

出版时间：郑州大学出版社

作者：商勇

页数：134

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>

<<利率模型与应用研究>>

内容概要

利率及其动态机制可以说是现代金融理论中最为复杂的部分。在美国等发达国家，利率模型的研究一直是金融学领域的重点和热点。1996年以来，我国的利率市场化改革稳步推进。目前利率市场化水平已经大大提高，除了银行存贷款利率外，其他商业性利率均已经放开。当然，完全实现利率市场化还需要一个较长的过程，需要从理论上和实践上进行更深入的研究。因而对利率模型（或利率期限结构模型）的探讨从理论上和应用上都具有现实意义。

<<利率模型与应用研究>>

书籍目录

第一章 引言第一节 研究背景第二节 内容安排第三节 研究方法第四节 主要创新第二章 利率模型理论基础第一节 基本概念第二节 利率理论概述第三节 利率模型的理论基础第四节 资产定价的一般方法第五节 利率期限结构的经济学分析第六节 利率期限结构外文文献综述第七节 国内利率模型研究现状第三章 常见利率模型及其评价第一节 单因子扩散模型第二节 多因子扩散模型第三节 校正模型第四节 HJM模型第五节 利率模型的新发展--市场模型第六节 我国利率模型的构建第四章 我国利率模型的实证分析第一节 我国国债市场概述第二节 我国利率基本特征与统计检验第三节 我国利率期限结构的静态估计第四节 我国利率模型的动态估计第五节 国债回购利率的主成分分析第五章 利率模型应用研究第一节 利率风险第二节 利率模型与风险管理第三节 利率波动率预测第四节 利率模型与市场模型定价第六章 结论和进一步研究方向参考文献

<<利率模型与应用研究>>

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>