

<<利率衍生品的定价与应用>>

图书基本信息

书名：<<利率衍生品的定价与应用>>

13位ISBN编号：9787566302700

10位ISBN编号：7566302701

出版时间：2012-4

出版时间：对外经贸大学出版社

作者：周丽

页数：184

字数：212000

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>

## <<利率衍生品的定价与应用>>

### 内容概要

周丽所著的《利率衍生品的定价与应用》研究利率衍生品的定价，以建立三因素带有跳跃特征的随机均值随机波动率利率期限结构模型为基础，研究了五种利率衍生品，包括可转换债券、浮动利率债券、利率期货、远期利率协议和利率互换的定价问题。

# <<利率衍生品的定价与应用>>

## 书籍目录

- 序
- 前言
- Preface
- 第1章 理论基础与方法
  - 1.1 研究背景
  - 1.2 利率期限结构理论与模型的研究现状
  - 1.3 利率期限结构模型的实证研究现状
  - 1.4 国内外关于利率衍生品定价方法的研究现状
  - 1.5 研究内容
  - 1.6 小结
- 第2章 利率期限结构模型的建立
  - 2.1 三个关键问题
  - 2.2 模型的建立
  - 2.3 实证方法
  - 2.4 模型估计
  - 2.5 小结
- 第3章 可转换公司债券
  - 3.1 可转换公司债券的介绍
  - 3.2 可转换公司债券的定价
  - 3.3 可转换公司债券定价实证研究
  - 3.4 可转换债券发展的总结与展望
  - 3.5 小结
- 第4章 浮动利率债券
  - 4.1 浮动利率债券的介绍
  - 4.2 浮动利率债券的定价
  - 4.3 股票收益关联浮动利率保险债券的设计与定价
  - 4.4 小结
- 第5章 远期利率协议与利率期货
  - 5.1 远期利率协议
  - 5.2 利率期货
  - 5.3 债券投资组合价格敏感性的风险分析
  - 5.4 小结
- 第6章 利率互换
  - 6.1 我国利率互换市场现状
  - 6.2 我国利率互换市场存在的问题
  - 6.3 利率互换交易定价理论
  - 6.4 利率互换交易定价方法
  - 6.5 小结
- 参考文献
- 后记
- 致谢

<<利率衍生品的定价与应用>>

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>