

<<住房抵押贷款证券化>>

图书基本信息

书名：<<住房抵押贷款证券化>>

13位ISBN编号：9787810983860

10位ISBN编号：7810983865

出版时间：2005-6

出版时间：

作者：施方

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>

<<住房抵押贷款证券化>>

内容概要

本书在理论方面有一定创新。

一是在提前偿付预测模型中提出的Weibull分布提前偿付模型，是对当前普通采用的Log-logis-tic模型和指数模型的突破。

二是在定价方式中，为了弥补常用的静态利差定价法中用以贴现国库券的收益率固定不变的缺点，引入CIR国库券定价法对国库券利率随机过程的描述及方法，并结合付息国库券的定价思想，在此基础上进行拓展，提出了CIR抵押支持证券定价法，建立了自由市场利率下抵押支持证券的利差定价模型。

三是在微分方程定价中，运用了John C. Hull总结的一般特衍生证券微分方程的方法，建立了在自由利率条件下，住房抵押贷款支持证券的微分方程定价法，开辟了一条建立住房抵押贷款支持证券微分方程的新方法。

本书最后还根据我国的实际情况，对我国证券化的运作和定价提出了自己的观点。

<<住房抵押贷款证券化>>

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>