

<<利率模型>>

图书基本信息

书名：<<利率模型>>

13位ISBN编号：9787810989091

10位ISBN编号：781098909X

出版时间：2007-1

出版时间：上海财经大学出版社

作者：王安兴

页数：208

字数：201000

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>>

内容概要

本书系统地介绍了资产定价的基本原理、单因素和多因素利率模型、基本利率衍生产品的定价。本书尽可能用通俗的语言详尽介绍了利率模型和估价模型，只要读者具有微积分、概率论和伊藤积分的初步知识，就可以学习和掌握利率模型和基本利率衍生产品的定价技术。

本书适合于作为证券投资等金融工程或金融数学专业本科生、硕士研究生和其他相关专业硕士研究生的利率模型课程学习用参考教材，也可以作为相关金融从业人员（如固定收益分析人员）学习和应用利率模型的参考书，对研究随机利率条件下的衍生产品定价的工作人员也有参考价值。

<<利率模型>>

书籍目录

1 利率与利率期限结构	1.1 理论利率概念	1.1.1 瞬时利率与银行账户	1.1.2 零息票债券与即期利率、收益曲线	1.1.3 远期利率	1.2 市场利率	1.2.1 借贷市场	1.2.2 单利利率与远期利率、瞬时远期利率	1.2.3 年复利利率与远期利率、瞬时远期利率	1.2.4 互换率与远期互换率	1.3 拟合收益曲线的技术方法	1.3.1 息票剥离法	1.3.2 样条函数法	1.3.3 Nelson—Siegel模型及其扩展模型	1.3.4 应用技术方法拟合我国收益曲线	问题与练习2 资产定价与利率期限结构	2.1 资产、交易策略以及套利	2.1.1 市场描述	2.1.2 资产描述	2.1.3 资产交易策略与套利	2.2 风险中性概率测度与风险的市场价格	2.2.1 风险中性概率测度	2.2.2 风险的市场价格	2.2.3 风险中性定价	2.3 定价的其他概率测度	2.3.1 资产定价的测度变换原理	2.3.2 远期鞅测度	2.3.3 互换鞅测度	2.3.4 欧式期权定价	2.4 远期价格与期货价格	2.4.1 远期价格	2.4.2 期货价格	2.4.3 远期价格与期货价格的比较	2.5 利率衍生产品定价的Black模型	2.5.1 Black—Scholes—Merton模型	2.5.2 债券期权、利率上限(下限)与互换期权定价	2.5.2.1 债券期权定价的Black公式	2.5.2.2 利率上限(下限)定价的：Black公式	2.5.2.3 互换期权定价的Black公式	2.5.2.4 应用：Black公式的问题	2.6 (债券)资产价格的偏微分方程	2.6.1 单因素扩散模型	2.6.2 多因素扩散模型	2.6.3 套期保值策略	问题与练习3 单因素利率模型4 多因素利率模型5 利率模型的标定与执行6 Health-Jarrow-Morton模型7 市场模型参考文献
-------------	------------	-----------------	-----------------------	------------	----------	------------	------------------------	-------------------------	-----------------	-----------------	-------------	-------------	-----------------------------	----------------------	--------------------	-----------------	------------	------------	-----------------	----------------------	----------------	---------------	--------------	---------------	-------------------	-------------	-------------	--------------	---------------	------------	------------	--------------------	----------------------	------------------------------	----------------------------	------------------------	-----------------------------	------------------------	-----------------------	--------------------	---------------	---------------	--------------	---

<<利率模型>>

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>