

中国利率衍生产品的定价和保值



[中国利率衍生产品的定价和保值_下载链接1](#)

著者:郑振龙、/康朝锋/国别:

出版者:北京大学出版社

出版时间:2006-7

装帧:简装本

isbn:9787301108680

本书首先依次介绍了国内外基本的利率衍生产品，运用随机过程描述利率动态的理论依据和基本方法，基本的连续利率模型和离散利率模型，离散利率模型的估计方法。然后对利率衍生产品定价和保值的一般原理进行了概括。接着以BDT模型为基准，运用Matlab和Excel等工具，对国家开发银行发行的可回售债券和可赎回债券，以及商业银行近年来发行的与利率关联的结构性存款进行了定价和保值分析。最后在考察了期权对利率风险衡量技术的影响的基础上，深入分析了含权债券利率风险衡量的问题，并论证了内嵌期权对银行利率风险管理的影响。

作者介绍:

目录:

[中国利率衍生产品的定价和保值_下载链接1](#)

标签

金融工程

利率

评论

康朝锋的博士论文

20140213在读，作者04年的博士论文，翻了翻，至少数学书能接受，前面70页在堆砌利率模型，后面用国开行的embedded callable option bond实证分析，该实证是用单因子利率模型，二叉树定价，作者自己也说了比较，呃，比较成熟的工具。数据是上交所场内数据来建模利率期限结构。对于2004年来说，真的不容易了，已经是开拓和学术前沿了。每天午饭后读一读，一百多页。

[中国利率衍生产品的定价和保值_下载链接1](#)

书评

[中国利率衍生产品的定价和保值_下载链接1](#)