

中国银行间市场利率动态行为研究



[中国银行间市场利率动态行为研究_下载链接1](#)

著者:潘冠中

出版者:

出版时间:2009-9

装帧:

isbn:9787505885530

《中国银行间市场利率动态行为研究》研究了中国银行间市场利率的动态行为。首先，介绍了利率模型的发展和计量方法之应用对利率模型的推动作用、估计利率模型的计量方法和中国货币市场（主要是银行间市场）的交易。其次，在实证分析中，我们选择了估计利率模型的数据，揭示了中国银行间市场利率的一些动态特征，包括显著的均值回复效应、双曲模型是描述其动态变化的最佳单因子利率模型、利差特征和跳跃特征，并在理论上做出解释。

作者介绍:

目录:

[中国银行间市场利率动态行为研究_下载链接1](#)

标签

银行

投资

评论

[中国银行间市场利率动态行为研究_下载链接1](#)

书评

[中国银行间市场利率动态行为研究_下载链接1](#)