

基于跳扩散和随机相关的金融衍生产品定价模型研究



[基于跳扩散和随机相关的金融衍生产品定价模型研究_下载链接1](#)

著者:

出版者:

出版时间:2010-9

装帧:

isbn:9787030285270

《基于跳扩散和随机相关的金融衍生产品定价模型研究:以人民币汇率期权与债务抵押证券为对象》内容简介：金融创新是我国增强国际竞争力无法回避的战略选择，那么，如何对最具代表性的金融工具——金融衍生产品进行定价？怎样在金融创新中兼顾风险与收益、公平与效率？这些问题无不需要缜密的思考和相关模型的论证选取以及参数的估计方法等。这些金融领域富有挑战性的热点和难点问题，正是《基于跳扩散和随机相关的金融衍生产品定价模型研究:以人民币汇率期权与债务抵押证券为对象》的研究目标所在。

《基于跳扩散和随机相关的金融衍生产品定价模型研究:以人民币汇率期权与债务抵押证券为对象》以兼具理论与实用价值的跳扩散和随机相关定价技术为主线，着重针对两个主题进行了较系统的研究：一是，以人民币汇率期权为研究对象，揭示了人民币汇率变化规律、非线性跳变特征及人民币衍生产品——期权的定价机理；二是，以债务抵押证券（CDO）为研究对象，探讨了债务抵押证券（CDO）的定价模型构建及定价机理。

在研究过程中，《基于跳扩散和随机相关的金融衍生产品定价模型研究:以人民币汇率期权与债务抵押证券为对象》采取了机理分析、文献回顾、问题提出、模型构建、参数估计、（实证）模拟计算和检验等研究架构和层次递进方式，保证了研究的系统性和结论的新颖性与可信性，对我国金融产品创新、相关学者的研究和业界金融产品的设计与风险控制等，均具有参考价值。

作者介绍:

目录:

[基于跳扩散和随机相关的金融衍生产品定价模型研究_下载链接1](#)

标签

随机过程

评论

[基于跳扩散和随机相关的金融衍生产品定价模型研究_下载链接1](#)

[基于跳扩散和随机相关的金融衍生产品定价模型研究_下载链接1](#)