

《基于非参数估计的权证定价方法研究》

书籍信息

版次：1

页数：

字数：

印刷时间：2013年07月01日

开本：16开

纸张：胶版纸

包装：平装

是否套装：否

国际标准书号ISBN：9787513625265

内容简介

《基于非参数估计的权证定价方法研究》直接从权证价值的经济意义出发，通过数学变形，引入价值状况变量，提出一种新的权证定价思想——将权证定价问题归结为对状态价格生存函数积分的估计。基于这种定价思想，本书提出新的权证定价方法：完全非参数定价方法和基于模型的非参数修正定价方法，并将其应用到中国香港权证市场和内地权证市场。随后，针对中国内地权证市场的特殊性，将稀释效应和隐含波动率考虑在内，提出适用于中国内地股本权证的稀释效应下的基于参数模型的非参数修正定价方法。

目录

前言

第1章 绪论

1.1 研究背景及研究意义

1.1.1 权证发展历史综述

1.1.2 研究背景

1.1.3 研究意义

1.2 国内外权证定价文献综述

1.2.1 国外文献

1.2.2 国内文献

1.3 研究内容与研究目标

1.3.1 研究内容

1.3.2 研究目标

1.4 研究方法、结构和创新点

1.4.1 研究方法

[显示全部信息](#)

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www.tushupdf.com](http://www.tushupdf.com)