

《中国动态Nelson Siegel利率期限结构模型研究》

书籍信息

版次：1

页数：

字数：

印刷时间：2014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：9787550415065

内容简介

以上海证券交易所固定利率付息国债为研究对象,选取2006年7月~2011年6月每月最后一个交易日的数据,以观察利率期限结构的变化情况。研究得出,随着期限的增加,国债利率期限结构呈现上升趋势,这与流动性偏好理论相一致;不同期限的即期利率的相关性很强,基本表现为"同涨同跌"的特点。

作者简介

朱波1977年生于四川省宣汉县,1995年考入西南大学数学与统计学院,1999年6月获理学学士学位,2002年6月获理学硕士学位,同年9月考入中国社会科学院数量经济与技术经济研究所,2005年6月获经济学博士学位。2010年在美国东北大学商学院做访问学者。

在《管理世界》《数量经济技术经济研究》《经济学动态》《保险研究》《国际金融研究》《财经研究》《改革》《世界经济研究》及Economic Modeling等权威学术杂志上发表论文三十余篇,出版专著一部,出版译著三部。主持国家自然科学基金、教育部人文社会科学基金等项目十余项。

现任职于西南财经大学金融学院,从事金融学教学和科研工作。主讲连续时间金融、金融资产定价、实证金融、金融风险管理、衍生金融工具,资本市场研究等课程。主要研究方向为金融资产定价、金融风险理和实证金融。

目录

1 导言

- 1.1 本书的主要目的
- 1.2 本书的结构安排
- 1.3 本书的主要创新点

2 文献综述

- 2.1 传统利率期限结构理论
- 2.2 利率期限结构的静态估计方法
- 2.3 利率期限结构的动态模型
- 2.4 宏观金融模型

3 Nelson-Siegel-Svensson 期限结构模型

- 3.1 Nelson-Siegel 期限结构模型
- 3.2 Nelson-Siegel 模型的参数估计
- 3.3 Nelson-Siegel 模型的参数含义

- 3.4 Nelson-Siegel 模型
- 1 导言
- 1.1 本书的主要目的
- 1.2 本书的结构安排
- 1.3 本书的主要创新点

2文献综述2.1传统利率期限结构理论2.2利率期限结构的静态估计方法
2.3利率期限结构的动态模型2.4宏观金融模型3 Nelson-Siegel-Svensson期限结构模型
3.1Nelson-Siegel期限结构模型3.2Nelson-Siegel模型的参数估计3.3Nelson-
Siegel模型的参数含义3.4Nelson-Siegel模型3.5各国央行利率期限结构估计实践
3.6不同形状收益率曲线拟合效果比较3.7实证分析.....

[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)