第一图书网, tushu007.com

<<资本结构和利率衍生产品定价>>

图书基本信息

书名：<<资本结构和利率衍生产品定价>>

13位ISBN编号：9787121132025

10位ISBN编号：7121132028

出版时间：2011-4

出版时间：电子工业出版社

作者：王新哲

页数：252

版权说明：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：http://www.tushu007.com

内容概要

《资本结构和利率衍生产品定价》分为两部分，第一部分以资本结构为主题，研究利率市场化下的企业最优资本结构模型、企业筹资决策与资本结构之间的关系、企业财务困境成本与最优资本结构之间的关系。
第二部分研究两个无套利利率期限结构模型的应用，同时研究基于对数正态分布的期限结构模型的利率上限定价和基于熵定价理论的利率期权与美式期权估值，并对洪都航空投资决策与资本结构和歌华有线可转换债券定价进行了实证研究。
《资本结构和利率衍生产品定价》可作为财务管理、金融学、金融工程、应用数学、管理工程等专业本科生、研究生、mba学院、企业和金融管理的从业人员的参考书。

书籍目录

资本结构和利率衍生产品定价目录序一序二第1章 绪论 11 写作背景和意义 12 内容和结构 11第2章 资本结构与利率期限结构理论综述 141 国外资本结构理论研究 142 国内资本结构理论研究 363 国外利率期限结构研究 524 国内利率期限结构研究 715 小结 74第3章 利率市场化对企业资本结构的影响 771 利率市场化概要 772 利率变化对企业资本结构的影响 903 企业资本结构对利率变化的不同反映 984 利率市场化对商业银行资本结构的影响 995 小结 111第4章 利率市场化下企业最优资本结构模型 1121 引言 1122 基于静态利率模型的企业最优资本结构 1133 基于动态利率模型的企业最优资本结构 1184 小结 120第5章 利率市场化下企业筹资决策与资本结构之间的关系 1211 引言 1212 企业筹资净现值的概念及其计算公式 1223 企业动态净现值模型与资本结构的关系 1254 小结 131第6章 利率市场化下企业财务困境成本与最优资本结构 1321 引言 1322 财务困境成本定义与构成 1333 考虑财务困境成本的企业最优资本结构模型 1354 小结 142第7章 洪都航空投资决策与资本结构实证研究 1431 江西洪都航空工业股份有限公司背景 1432 静态利率期限结构的估计 1453 两种利率情形下项目的净现值的比较 1474 两种利率情形下洪都航空资本结构 1495 小结 150第8章 基于Black-Derman-Toy扩展模型的国债和国债期权定价 1511 引言 1512 扩展的BLACK-DERMAN-TOY模型 1523 模型的应用 1564 小结 158第9章 Heath-Jarrow-Morton模型框架下基于通货膨胀指数的欧式期权定价 1601 引言 1602 HJM模型的基本假设关系 1613 模型的建立及其主要结果 1634 基于CPI的欧式期权定价研究 1675 小结 170第10章 基于对数正态分布的期限结构模型的利率上限定价 1711 引言 1712 基于简单远期利率模型的利率上限定价 1743 基于连续远期利率模型的利率上限定价 1784 算例 1845 小结 185第11章 基于熵定价理论的利率期权和美式债券期权定价 1861 引言 1862 基于熵定价理论的利率期权定价 1883 基于熵定价理论的美式债券期权定价 1934 小结 199第12章 歌华可转换债券定价实证 2011 引言 2012 基于期限结构模型的可转债定价模型 2043 歌华可转换债券定价实证 2074 小结 222附录A 连续时间随机过程有关理论知识 2231 Ito过程 2232 Ito引理（定理） 2233 Radon-Nikodym导数 2254 Cameron-Martin-Girsanov定理 225附录B 期权定价的鞅方法 227参考文献 230后记 252

第一图书网, tushu007.com

版权说明

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:http://www.tushu007.com