

基于非参数估计的权证定价方法研究



作者：樊鹏英著

出版社：北京：中国经济出版社

出版日期：2013.07

总页数：215

介绍：本书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。基于这种定价思想文中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，并将其应用到香港权证市场和中国权证市场。随后，针对中国权证市场的特殊性，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。

说明：登录教客网（<https://www.jiaokey.com/book/detail/13343382.html>）查找全本阅读方式

基于非参数估计的权证定价方法研究 评论地址：<https://www.jiaokey.com/book/detail/13343382.html>

教客网提供千万本图书阅读地址。

<https://www.jiaokey.com/book/detail/13343382.html>

书名：基于非参数估计的权证定价方法研究