

<<中国银行间市场利率动态行为研究>>

图书基本信息

书名：<<中国银行间市场利率动态行为研究>>

13位ISBN编号：9787505885530

10位ISBN编号：7505885537

出版时间：2009-9

出版时间：经济科学出版社

作者：潘冠中

页数：139

字数：130000

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>

## <<中国银行间市场利率动态行为研究>>

### 内容概要

本书研究了中国银行间市场利率的动态行为。

首先，介绍了利率模型的发展和计量方法之应用对利率模型的推动作用、估计利率模型的计量方法和中国货币市场（主要是银行间市场）的交易。

其次，在实证分析中，我们选择了估计利率模型的数据，揭示了中国银行间市场利率的一些动态特征，包括显著的均值回复效应、双曲模型是描述其动态变化的最佳单因子利率模型、利差特征和跳跃特征，并在理论上做出解释。

#### 作者简介

潘冠中，1976年生，经济学博士，副教授，现在云南财经大学金融学院工作。  
主要研究方向为金融计量。

在《数量经济技术经济研究》、《财经研究》等中文核心期刊上发表论文多篇。

书籍目录

第1章 利率模型的发展及计量方法之应用 1.1 引言 1.2 经典的单因子利率模型 1.3 计量方法应用于利率模型的估计和检验 1.4 多因子模型与跳跃模型 1.5 我国学者的研究第2章 扩散利率模型的极大似然估计 2.1 扩散模型参数估计方法 2.1.1 广义矩方法 2.1.2 模拟矩方法 2.2 可直接使用MLE的利率模型 2.2.1 默顿模型 2.2.2 GBM模型 2.2.3瓦西塞克模型 2.2.4 CIR模型 2.2.5 AG模型 2.3 近似NLE的利率模型 2.3.1 埃特-萨哈利尔的埃米特展开法 2.3.2 CKLS模型 2.3.3 埃特-萨哈利尔模型 2.3.4 双曲模型第3章 中国货币市场与货币市场利率 3.1 中国货币市场的发展 3.1.1 银行间市场成员 3.1.2 银行间市场交易量变动 3.1.3 银行拆借和债券回购交易品种 3.2 中国货币市场利率 3.3 货币市场利率与央行货币政策 3.3.1 货币市场利率与央行目标利率调整 3.3.2 存款准备金政策与货币市场利率 3.3.3 公开市场操作与货币市场利率 3.4 小结第4章 单因子利率期限结构模型参数估计的数据选择 4.1 引言 4.2 单因子利率模型参数估计的数据选择原则 4.3 中国货币市场及银行间市场利率 4.4 选择最佳替代利率 4.5 小结和评论第5章 基于CKLS模型的中国货币市场利率的实证分析第6章 应该用哪一个模型来描述中国货币市场利率的动态变化？第7章 拆借需求的天花板效应与正利差第8章 中国银行间市场利率的跳跃及其影响因素分析参考文献致谢

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>