

《新型寿险合同内嵌期权研究》

图书基本信息

书名：《新型寿险合同内嵌期权研究》

13位ISBN编号：9787504468697

10位ISBN编号：750446869X

出版时间：2010-5

作者：周桦

页数：162

版权说明：本站所提供下载的PDF图书仅提供预览和简介以及在线试读，请支持正版图书。

更多资源请访问：www.tushu111.com

《新型寿险合同内嵌期权研究》

内容概要

《新型寿险合同内嵌期权研究——基于中国市场的分析》以金融经济学风险中性定价法为贯穿始终的方法，主要研究以下几个问题：

投资连结保险产品内嵌GMMB与GMDB在Vasicek随机利率下的定价问题。

投资连结保险产品内嵌GMMB与GMDB在Vasicek利率模型下的对冲及对冲误差比较的问题。

分红寿险产品在不考虑与考虑死亡因素的条件下的定价问题。

以万能险为例，使用最小二乘蒙特卡罗方法计算退保权利的价值。

比较几种平滑机制对消费者与保险人的优劣。

《新型寿险合同内嵌期权研究——基于中国市场的分析》由周桦所著

。

《新型寿险合同内嵌期权研究》

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:www.tushu111.com