

住房抵押贷款证券定价研究

董纪昌, 刘纪学, 汪成豪, 袁宏, 王雯珺

收稿日期 修回日期 网络版发布日期 接受日期

摘要 在分析MBS(Mortgage-backed securities)定价影响因素的基础上,考虑模型的稳健性和可操作性,利用Schwartz和Torous定价模型,以建元2007-1RMBS作为研究对象,模拟出BDT利率模型下的利率期限结构,再结合提前还款模型中的PSA法确定贷款现金流,进而确定期权调整价差OAS,构建了适用于我国的MBS定价模型.

关键词 [住房抵押贷款证券](#) [提前偿还](#) [期权调整价差](#)

分类号

DOI:

对应的英文版文章: [2009120046](#)

通讯作者:

作者个人主页: 董纪昌; 刘纪学; 汪成豪; 袁宏; 王雯珺

扩展功能

本文信息

- ▶ [Supporting info](#)
- ▶ [PDF](#) (812KB)
- ▶ [\[HTML全文\]](#) (0KB)
- ▶ [参考文献\[PDF\]](#)
- ▶ [参考文献](#)

服务与反馈

- ▶ [把本文推荐给朋友](#)
- ▶ [加入我的书架](#)
- ▶ [加入引用管理器](#)
- ▶ [引用本文](#)
- ▶ [Email Alert](#)

相关信息

- ▶ [本刊中 包含“住房抵押贷款证券”的相关文章](#)
- ▶ [本文作者相关文章](#)

- [董纪昌](#)
- [刘纪学](#)
- [汪成豪](#)
- [袁宏](#)
- [王雯珺](#)