



首页  
概况  
研究机构  
学者介绍  
成果文库  
文献数据  
培训教育  
对外交流

□ 您的位置: 首页 → 数技经济研究杂志 → 理论与方法研究

## 可转换债券定价的有限元方法

**内容摘要** 本文考虑了赎回、回售以及提前转换等条款,建立了可转换债券的定价模型。提出了对应于不同条款的边界条件,导出了有限元方法的求解格式。对可转换债券的价值进行了数值模拟,讨论了赎回、回售条款对可转换债券价值的影响。对民生转债(100016)和钢钒转债(125629)等两支可转换债券的价值进行了数值模拟,将理论值与市场值进行了比较。

**关键词** 可转换债券;有限元方法;数值模拟

Search the Web

Find It

地址:北京市建国门内大街5号 邮政编码:100732 电话及传真:010-65125895、010-65137561

版权所有 (c) 中国社会科学院数量经济与技术经济研究所

联系我们 E-mail to: iqte@cass.org.cn