



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 → 现实经济问题研究

## 期权定价的混合型二叉树模型及其应用研究

摘要:本文主要针对传统的二叉树定价模型的应用局限及收敛性特点,从有效减少模型计算的复杂程度考虑,分析与探讨一种粗细网格并存的混合型二叉树定价模型,从而在不过多增加模型计算工作量的前提下,使其估计精度能有一个较大程度的提高。实例研究表明,该模型对许多金融衍生证券,尤其是应用十分广泛的障碍期权的价格估计具有明显的改进效果。

关键词:期权定价 网格方法 混合模型, 二叉树

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