



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

Search the Web

Find It

□ 您的位置: 首页 → 数技经济研究杂志 → 应用研究

## 服从多种形式跳过程的期权定价模型

[摘要] 股票价格过程包含跳跃和扩散两种随机运动, 其中跳跃是重大信息到达对股票价格的冲击。本文将引起股票价格跳跃的重大信息按照相对重要程度分为  $n$  类, 建立了多种形式跳的股票价格过程, 运用无风险证券、股票和期权复制其他期权的方法, 推导出期权价值方程和欧式期权定价公式, 给出了引起股票价格跳跃的不可观测参数的确定方法。

关键词 跳—扩散过程 信息 期权定价

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