

标的资产服从几何Levy过程的股票价格模型的期权定价

熊双平

(上海师范大学数理信息学院, 上海200234)

中图分类号: 0211.6 F830.9

摘要: 利用公平保费原则和价格过程的实际概率测度推广了Mogens Bladt和Hina HviidRydberg关于欧式期权定价的结果. 在假定股票价格过程遵循几何Levy过程, 并且股票预期收益率、波动率 and 无风险利率均为时间函数的情况下, 获得了欧式期权精确定价公式和买权与卖权之间的平价关系.

关键词: Levy过程;;Black Scholes公式;;保险精算定价;;期权定价

 [阅读文章\(pdf\)](#)

关闭本页