



- 首页
- 期刊介绍
- 基本信息
- 编委会
- 编辑团队
- 期刊荣誉
- 收录一览
- 征稿简则
- 作者中心
- 编辑中心
- 订阅指南
- 联系我们
- English

吉首大学学报自然科学版 » 2007, Vol. 28 » Issue (5): 29-33 DOI:

数学

[最新目录](#) | [下期目录](#) | [过刊浏览](#) | [高级检索](#)

« Previous Articles | Next Articles »»

巨灾指数模型及其衍生品套利定价方法

(湖南科技大学商学院, 湖南 湘潭 411201)

Catastrophe Index Model and Insurance Actuary Pricing of the Derivatives

(College of Business, Hunan University of Science and Technology, Xiangtan 411201, Hunan China)

- 摘要
- 参考文献
- 相关文章

全文: [PDF \(1370 KB\)](#) [HTML \(1 KB\)](#) 输出: [BibTeX](#) | [EndNote \(RIS\)](#) [背景资料](#)

摘要 考虑短期随机利率下, 损失指数价值过程为跳-扩散模型时巨灾指数衍生品的定价问题, 利用有套利定价的保险精算方法得到了巨灾选择权、巨灾债券的精确定价解和买权卖权间的平价关系, 并与传统无套利方法下巨灾指数衍生品的定价进行了比较, 从而推广了保险精算定价法相关结论.

关键词: 巨灾指数 随机利率 复合Poisson过程 保险精算

Abstract: Under jump-diffusion catastrophe index model, the author analyzes the pricing of catastrophe derivatives under stochastic interest rates with a compound Poisson process. By using the approach of insurance actuary pricing, the formulas of values of catastrophe options and catastrophe bonds are obtained.

Key words: catastrophe options stochastic interest rates compound Poisson process insurance actuary pricing

服务

- ▶ 把本文推荐给朋友
- ▶ 加入我的书架
- ▶ 加入引用管理器
- ▶ E-mail Alert
- ▶ RSS

作者相关文章

- ▶ 周俊

基金资助:

湖南省自然科学基金资助项目 (06JJ20019); 湖南省社会科学基金资助项目 (06YB63); 产业经济研究基地开放基金项目 (KF0610)

作者简介: 周俊(1970-), 女, 湖南湘潭人, 湖南科技大学商学院讲师, 硕士, 主要从事概率论与数理金融研究.

引用本文:

周俊. 巨灾指数模型及其衍生品套利定价方法[J]. 吉首大学学报自然科学版, 2007, 28(5): 29-33.

ZHOU Jun. Catastrophe Index Model and Insurance Actuary Pricing of the Derivatives[J]. Journal of Jishou University (Natural Sciences Edit, 2007, 28(5): 29-33.

[1] HELYETTE GEMAN, YOR M. Bessel Process, Asian Options, and Perpetuities [J]. Mathematical Finance, 1993, (4): 349-375.

[2] CUMMINS J D, GEMAN H. Pricing Catastrophe Insurance Futures and Call Spreads: An Arbitrage Approach [J]. Journal of Fixed Income, 1995, (1): 46-57.

[3] CLAUS VORM CHRISTENSEN, HANSPETER SCHMIDLI. Pricing Catastrophe Insurance Products Based on Actually Reported Claims [J]. Insurance: Mathematics and Economics, 2000, 27(2): 189-200.

[4] KNUT AASE. An Equilibrium Model of Catastrophe Insurance Futures and Spreads [J]. The GENEVA Papers on Risk and Insurance-Theory, 1999, 24(1): 69-96.

[5] BLADT M, RØDBERG T H. An Actuarial Approach to Option Pricing Under the Physical Measure and Without Market Assumptions [J]. Insurance: Mathematics and Economics, 1998, 22(1): 65-73.

版权所有 © 2012 《吉首大学学报（自然科学版）》编辑部

通讯地址：湖南省吉首市人民南路120号《吉首大学学报》编辑部 邮编：416000

电话传真：0743-8563684 E-mail: xb8563684@163.com 办公QQ: 1944107525

本系统由北京玛格泰克科技发展有限公司设计开发 技术支持: support@magtech.com.cn