



华东师范大学学报(自然科学版) » 2011, Vol. 2011 » Issue (3): 12-20 DOI:

应用数学与基础数学

最新目录 | 下期目录 | 过刊浏览 | 高级检索

« Previous Articles | Next Articles »»

幂式期权在跳扩散模型下的定价

苏小囡, 王文胜

华东师范大学 金融与统计学院, 上海 200241

Pricing power options in a jump diffusion model

SU Xiao-nan, WANG Wen-sheng

College of Finance and Statistics, East China Normal University, Shanghai 200241, China

- 摘要
- 参考文献
- 相关文章

全文: PDF (350 KB) HTML (0 KB) 输出: BibTeX | EndNote (RIS) 背景资料

摘要 假设标的资产价格服从跳扩散过程, 市场利率满足Vasicek模型, 当随机利率与资产价格相关时, 通过测度变换的方法, 选取不同的概率测度, 给出幂式期权的价格公式并得到几种特殊情况时的结论.

关键词: 跳扩散模型 幂式期权 随机利率 测度变换 跳扩散模型 幂式期权 随机利率 测度变换

Abstract: Under the assumption that the underlying asset prices obey jump diffusion processes and the market interest satisfies Vasicek model, and when the interest is correlated with the asset prices, by the way of change of measure, a closed solution of pricing of power option was given. Moreover, some special situations were considered.

Key words: power options stochastic interest rate change of measure jump diffusion model power options stochastic interest rate change of measure

收稿日期: 2010-01-01;

通讯作者: 苏小囡

引用本文:

苏小囡,王文胜. 幂式期权在跳扩散模型下的定价[J]. 华东师范大学学报(自然科学版), 2011, 2011(3): 12-20.

SU Xiaonan, WANG Wensheng. Pricing power options in a jump diffusion model[J]. Journal of East China Normal University(Natural Sc, 2011, 2011(3): 12-20.

没有本文参考文献

[1] 王伟;王文胜;王帅. 跳扩散模型中远期生效看涨期权的定价(英)[J]. 华东师范大学学报(自然科学版), 2009, 2009(5): 107-117.

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

- ▶ 苏小囡
- ▶ 王文胜

版权所有 © 2011 《华东师范大学学报(自然科学版)》编辑部
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