

金融工程中资产收益的连续时间模型评述

胡素华, 张世英, 张彤

天津大学管理学院, 天津, 300072

Review on Continuous-Time Equity Return Models in Financial Engineering

HU Su-hua, ZHANG Shi-ying, ZHANG Tong

Management School of Tianjin University, Tianjin 300072, China

- [摘要](#)
- [参考文献](#)
- [相关文章](#)

Download: [PDF \(KB\)](#) | [HTML \(KB\)](#) | Export: [BibTeX](#) or [EndNote \(RIS\)](#) | [Supporting Info](#)

摘要 总结了在过去30年中金融资产收益连续时间模型的发展及主要成果,讨论了迄今连续时间模型参数估计的主要方法,其中特别讨论了MCMC方法;最后指出了现在和未来该领域研究所面临的主要课题。

关键词: [连续时间模型](#) [跳跃-扩散模型](#) [马尔可夫链蒙特卡罗方法](#) [资产收益](#) [波动](#)

Abstract: Firstly, this paper surveys and assesses the development and main fruits of continuous-time equity return models during the last 30 years. Then it discusses the estimation methods of these models, and mainly studies the MCMC method. In the end, we also point out the new areas of future research along these lines.

收稿日期: 2005-04-12;

基金资助: 国家自然科学基金资助项目(70301006、70471050)

引用本文:

胡素华, 张世英, 张彤. 金融工程中资产收益的连续时间模型评述[J]. 中国管理科学, 2006, V(2): 24-32

Service

[把本文推荐给朋友](#)
[加入我的书架](#)
[加入引用管理器](#)

[Email Alert](#)
[RSS](#)

作者相关文章

[胡素华](#)
[张世英](#)
[张彤](#)

没有本文参考文献

没有找到本文相关文章