

عنوان مقاله:

الگوی قیمت گذاری برگ های اختیار معامله اوراق بهادار

محل انتشار:

فصلنامه تحقیقات مالی، دوره 4، شماره 13 (سال: 1378)

تعداد صفحات اصل مقاله: 28

نویسنده:

امید پور حیدری

خلاصه مقاله:

مهم ترین وظیفه بورس اوراق بهادار ' ایجاد یک بازار کارآ برای قیمت گذاری عادلانه اوراق بهادار می باشد. این وظیفه از طریق خبرگان مالی اعمال می شود. خبرگان مالی اطلاعات مورد نیاز برای قیمت گذاری را بر اساس مدل های قیمت گذاری که بر پایه مفروضات صحیح و مطابق بازار طراحی شده است بدست می آورند. انواع اوراق مالی قابل معامله در بورس اوراق بهادار سهام عادی، اوراق قرضه، اختیار معامله اوراق بهادار و قراردادهای آتی می باشد. در این مقاله سه مدل قیمت گذاری اختیار معامله اوراق بهادار شامل مدل توزیع یکنواخت قیمت سهام، مدل توزیع دو جمله ای قیمت سهام و مدل توزیع نرمال لگاریتمی مورد بحث و بررسی قرار گرفته است.

کلمات کلیدی:

اختیار معامله اوراق بهادار، اوراق قرضه، بورس اوراق بهادار، مدل های قیمت گذاری

لینک ثابت مقاله در پایگاه سیویلیکا:

<https://civilica.com/doc/1398764>

