

عنوان مقاله:

قیمت گذاری اختیار آسیایی با استفاده از یادگیری ماشین

محل انتشار:

اولین کنفرانس بین المللی جهش علوم مدیریت، اقتصاد و حسابداری (سال: 1400)

تعداد صفحات اصل مقاله: 11

نویسندگان:

علی بلفکه - کارشناسی ارشد ریاضی مالی، گروه ریاضی، دانشگاه اراک، اراک

نوراله موسوی - گروه ریاضی، دانشگاه اراک، اراک

سیما مشایخی - گروه ریاضی، دانشگاه اراک، اراک

خلاصه مقاله:

توسعه سریع فناوری رایانه و یادگیری ماشین باعث افزایش علاقه پژوهشگران در حل چالش های معروف در علوم مختلف شده است. در زمینه های مالی و مدیریت ریسک، قیمتگذاری اختیارات میانگین حسابی آسیایی یک چالش در صنعت مالی است. در غیاب جوابتحلیلی فرم-بسته برای این نوع اختیارات، جوابهای عددی مورد نیاز است. انتخاب یک روش عددی خوب شامل بهترین ترکیب از معیارهای سرعت، دقت، سادگی و عمومیت هست. یادگیری عمیق ماشین یک روش موثر و کاربردی برای محاسبات قیمت گذاری اختیارات آسیایی فراهم می کند. در این مقاله ضمن معرفی اختیارات آسیایی، روش گرادیان کاهش در یادگیری ماشین و تابع فعالیت های موجود در یادگیریمعمیق ماشین، یک روش کاربردی و موثر مبتنی بر یادگیری ماشین برای قیمت گذاری اختیارات آسیایی را بررسی می کنیم.

کلمات کلیدی:

یادگیری ماشین، شبکه های عصبی مصنوعی، یادگیری عمیق، قیمت گذاری اختیار آسیایی حسابی، قیمت گذاری اختیار آسیایی هندسی

لینک ثابت مقاله در پایگاه سیویلیکا:

<https://civilica.com/doc/1463827>

