

عنوان مقاله:

یک روش عددی برای ارزش گذاری اختیار معاملات اروپایی در بازارهای غیرنقدی

محل انتشار:

سومین کنفرانس ریاضیات مالی و کاربردها (سال: 1391)

تعداد صفحات اصل مقاله: 14

نویسندگان:

رشید خضری پورقرایی - دانشگاه شیخ بهایی اصفهان

صفا ستارداغی - دانشگاه شیخ بهایی اصفهان

خلاصه مقاله:

نقدینگی بازار یکی از مباحث بسیار مهم در مدیریت ریسک مالی است. در بازارهای غیرنقدی، معاملات بر قیمت دارائی بنیادین تأثیر می گذارد که ما به آن تغییر قیمت می گوئیم. در یک بازار نقدی مدل ارزش گذاری اختیار معامله بصورت یکمسئله ی بلک- شولز خطی شناخته می شود. مدل های غیرخطی زمانی ظاهر می شوند که هزینه ی معاملات یا اثرات بازارهای غیرنقدی مدنظر قرار بگیرند.

کلمات کلیدی:

تغییر قیمت، بازارهای غیرنقدی، مدل غیرخطی بلک- شولز، ارزش گذاری اختیار معاملات اروپایی، تجزیه و تحلیل عددی

لینک ثابت مقاله در پایگاه سیویلیکا:

<https://civilica.com/doc/352641>

