

عنوان مقاله:

قیمت گذاری اختیار معامله آسیایی تحت موجک با استفاده الگوریتم موازی

محل انتشار:

اولین همایش ملی علوم کاربردی و مهندسی (سال: 1395)

تعداد صفحات اصل مقاله: 8

نویسنده:

مهسا شهبازی

خلاصه مقاله:

در این تحقیق هدف ارایه روشی است که در آن الگوریتم اختیار معامله آسیایی را براساس تبدیل موجکهای گسسته قیمت گذاری می نماید و به این صورت اختیار آسیایی تحت تاثیر تغییرات ناگهانی بازار سرمایه قرار نمی گیرد. در این جا یک مدل جدیدی برای قیمت گذاری این اختیار با استفاده از موجکها ارایه می شود. در ابتدا با استفاده از تابع مشخصه فرآیند، قیمت دارایی پایه در مدل جدید محاسبه می نماییم و فرمولی که برای قیمت گذاری این اختیار معامله تحت این مدل ارایه شده از فرآیند لوی بهره برده است و سپس با استفاده از موجکهای گسسته به قیمت گذاری می پردازیم. این رویکرد جدید بر اساس روش موجک، مسیرهای زمانی را در مقیاس متفاوت تجزیه می کند. هسته مدل قیمت گذاری براساس حل معادلات انتگرالی فردلهم محاسبه و نمایش هسته های موجود در معادلات براساس توابع موجکها دابشی به دست می آید. در اینجا به بحث در مورد موازی سازی الگوریتم پرداخته شده و نتایج عددی، نشان دهنده ی بهبود دقت بهره وری حاصل از این روش می باشد

کلمات کلیدی:

اختیار معامله، اختیار معامله آسیایی، موجک، آنالیز چندریزه ساز، ارزش گذاری ریسک خنثی

لینک ثابت مقاله در پایگاه سیویلیکا:

<https://civilica.com/doc/616601>

