



首页
概况
研究机构
学者介绍
成果文库
文献数据
培训教育
对外交流

□ 您的位置： 首页 → 数技经济研究杂志 → 05 目录

BDT模型的扩展及应用研究

内容提要：通过引入转移概率参数，证明了短期利率满足的一般动态变化方程，建立了离散形式的利率期限结构模型，讨论求解方法，从而拓展了BDT模型。同时，探讨了模型的理论应用，给出了息票国债与基于息票国债的欧式期权定价公式。最后，对BDT数例进行了校正，并针对息票国债，提出了一种新的定价方法，且进行了实证研究。

关键词：短期利率；BDT模型；二叉树；欧式期权

Search the Web

Find It

地址：北京市建国门内大街5号 邮政编码：100732 电话及传真：010-65125895、010-65137561
版权所有 (c) 中国社会科学院数量经济与技术经济研究所
联系我们 E-mail to: iqte@cass.org.cn