

随机利率下双币种期权的定价

郭培栋;张寄洲

(上海师范大学数理信息学院, 上海200234)

中图分类号: F830.9 0211.6

摘要: 双币种期权是为在国际贸易和投资中规避各种不同类型的风险而设计的一种期权, 在Black—Scholes的框架下, 运用偏微分方程的方法, 比较系统地讨论了在本国或地区利率遵循短期利率模型 (Vasicek模型) 下欧式双币种期权的定价模型, 并给出了相应的定价公式.

关键词: 双币种期权;;随机利率;;Vasicek模型;;期权定价

 [阅读文章\(pdf\)](#)

关闭本页