



吉首大学学报自然科学版 » 2007, Vol. 28 » Issue (1): 38-40 DOI:

数学 [最新目录](#) | [下期目录](#) | [过刊浏览](#) | [高级检索](#) ◀ Previous Articles | Next Articles ▶

房产价格服从一般 Ito^{\wedge} 过程的保证定价

(1.湖南农业大学理学院, 湖南 长沙 410128; 2.湖南财政经济学院, 湖南 长沙 410205)

Pricing Mortgage Insurance When House Price is Driven by a Genegal Ito^{\wedge} Process

(1.College of Science,Hunan Agricultural University,Changsha 410128,China;2.Hunan College of Finance and Economics,Changsha 410205,China)

- 摘要
- 参考文献
- 相关文章

全文: PDF (1042 KB) HTML (1 KB) 输出: BibTeX | EndNote (RIS) [背景资料](#)

摘要 假设未偿付额为常数且房产价格服从一般的 Ito^{\wedge} 过程, 得到了2类住房抵押贷款保证保险的传统鞅定价公式和保险精算定价公式, 并证明了2种方法的定价结果是完全一致的.

关键词: 住房抵押贷款 保证保险 期权 鞅定价 保险精算定价

Abstract: Obtain the martingale pricing formulas and the insurance actuary pricing formulas to two kinds of mortgage insurance,and also prove that they go all the way when the unpaid money is a constant and the house price is driven by a genegal Ito^{\wedge} process.

Key words: mortgage insurance option martingale pricing insurance actuary pricing

作者简介: 李晨 (1979-), 男, 湖南益阳人, 湖南农业大学理学院助教, 硕士, 主要从事概率统计研究.

引用本文:

李晨,陈丽萍. 房产价格服从一般 Ito^{\wedge} 过程的保证定价[J]. 吉首大学学报自然科学版, 2007, 28(1): 38-40.

LI Chen,CHEN Li-Ping. Pricing Mortgage Insurance When House Price is Driven by a Genegal Ito^{\wedge} Process[J]. Journal of Jishou University (Natural Sciences Edit, 2007, 28(1): 38-40.

[1] 毛宏,罗守成,唐国春.国外保险定价的发展及其对我国的借鉴 [J].运筹与管理,2003,12(2): 77-82.

[2] 戴建国,黄培清.住房抵押贷款定价研究进展 [J].管理工程学报,2001,15(1): 72-74.

[3] 陈丽萍,杨向群,李晨.Vasic ek利率模型下住房抵押贷款保证保险的鞅定价 [J].经济数学,2004, 21(4): 307-311.

[4] 闫海峰,刘三阳.广义Black-Scholes模型期权定价新方法保险精算方法 [J].应用数学和力学,2003,24(7): 730-738.

[1] 张元庆,刘洪霞.汇率期权的保险精算定价及均值分析[J].吉首大学学报自然科学版, 2010, 31(2): 33-36.

[2] 郭娜,刘新平.支付红利的几何亚式期权定价模型[J].吉首大学学报自然科学版, 2009, 30(3): 28-30.

[3] 邹湘江,王宗萍.环境基础设施BOT项目实物期权模式决策[J].吉首大学学报自然科学版, 2008, 29(3): 112-115.

[4] 朱丹.股价服从跳-扩散模型的可转换债券的定价[J].吉首大学学报自然科学版, 2008, 29(1): 34-38.

服务	
▶	把本文推荐给朋友
▶	加入我的书架
▶	加入引用管理器
▶	E-mail Alert
▶	RSS
作者相关文章	
▶	李晨
▶	陈丽萍

版权所有 © 2012《吉首大学学报（自然科学版）》编辑部
通讯地址：湖南省吉首市人民南路120号《吉首大学学报》编辑部 邮编：416000
电话传真：0743-8563684 E-mail：xb8563684@163.com 办公QQ：1944107525
本系统由北京玛格泰克科技发展有限公司设计开发 技术支持：support@magtech.com.cn