



云南大学学报(自然科学版) » 2003, Vol. 25 » Issue (2): 85-87 DOI:

数学

[最新目录](#) | [下期目录](#) | [过刊浏览](#) | [高级检索](#)

◀ | [Next Articles](#) ▶▶

一类带交易费用的含参数Black-Scholes模型

杨富春, 聂彩仁, 何青海

云南大学 数学系 云南 昆明 650091

A generalization of Black-Scholes model with parameter and transaction costs

YANG Fu-chun, NIE Cai-ren, HE Qin-hai

Department of Mathematics, Yunnan University, Kunming 650091, China

- [摘要](#)
- [参考文献](#)
- [相关文章](#)

全文: [PDF \(169 KB\)](#) [HTML \(KB\)](#) 输出: [BibTeX](#) | [EndNote \(RIS\)](#) [背景资料](#)

摘要 对Black-Scholes模型,讨论其在带有参数 α 及存在交易费用情形下的推广,得到了带有参数 α 及存在交易费用的衍生证券定价模型.

关键词: [Black-Scholes模型](#) [证券组合](#) [交易费用](#) [Leland模型](#)

Abstract: The Black Scholes model was generalized.A derivative securities pricing model with parameter and transaction costs was given.

Key words: [Black-Scholes model](#) [security portfolio](#) [transaction costs](#) [Leland model](#)

收稿日期: 2002-10-11;

基金资助:云南省教育厅科研基金资助项目(02ZD023).

引用本文:

杨富春,聂彩仁,何青海. 一类带交易费用的含参数Black-Scholes模型[J]. 云南大学学报(自然科学版), 2003, 25(2): 85-87.

YANG Fu-chun,NIE Cai-ren,HE Qin-hai. A generalization of Black-Scholes model with parameter and transaction costs[J]. , 2003, 25(2): 85-87.

[1] BLACK F, SCHOLES M. The pricing of option and corporate liabilities [J]. Journal of Political Economics,1973, 81: 637-659.[2] WILLMOTT P. Derivatives-the theory and practice of financial engineering[M]. West Sussex: John Wiley & Sons, 1988.[3] JOHN C H. Options, futures and other derivative securities[M]. Beijing: Huaxia Publishing House, 1998.[4] COX J C, ROSS S A. The valuation of options for alternative stochastic processes[J]. Journal of Financial Economics, 1976, (3): 145-166.[5] ZHANG Shun-ming, DENG Min. Generalization of the black-scholes model of security valuation[J]. Mathematics in Economics, 1999, 16(2): 13-20.[6] 聂彩仁,何树红. 一类广义的Black-Scholes模型的数值解[J]. 云南大学学报(自然科学版),2002,24(4): 241-244.[7] 李晋枝,乔克林,何树红. 限制卖空条件下的证券投资组合[J]. 云南大学学报(自然科学版),2002,24(6): 405-408.

没有找到本文相关文献

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

- ▶ [杨富春](#)
- ▶ [聂彩仁](#)
- ▶ [何青海](#)

版权所有 © 《云南大学学报(自然科学版)》编辑部

编辑出版: 云南大学学报编辑部 (昆明市翠湖北路2号, 650091)

电话: 0871-5033829(传真) 5031498 5031662 E-mail: yndxxb@ynu.edu.cn yndxxb@163.com