

## 一般Levy过程下带违约风险的可转换债券定价模型

杨立洪<sup>1</sup>, 蓝雁书<sup>1</sup>, 曹显兵<sup>2</sup>

1. 华南理工大学 数学科学学院, 广州 510640;

2. 北京工商大学 数学系, 北京 100048

收稿日期 2009-9-24 修回日期 网络版发布日期 接受日期

**摘要** 对可转换债券的相应标的股价 $S_t = S_0 \exp[(r-q)t + X_t]$ , 在 $X_t$ 是Levy过程的假设下, 运用傅立叶变换和残数定理, 得出了带有赎回和回售条款的可转换债券的定价公式; 同时, 结合Duffie关于衍生产品带违约风险的定价方法, 给出了带违约风险的可转换债券定价公式.

**关键词** [可转换债券](#) [Levy过程](#) [信用风险](#) [傅立叶变换](#) [残数定理](#)

**分类号** [O211.9](#) [F235.9](#)

**DOI:**

对应的英文版文章: [8-2009-1980](#)

通讯作者:

作者个人主页: [杨立洪<sup>1</sup>](#); [蓝雁书<sup>1</sup>](#); [曹显兵<sup>2</sup>](#)

### 扩展功能

本文信息

▶ [Supporting info](#)

▶ [PDF \(456KB\)](#)

▶ [\[HTML全文\] \(0KB\)](#)

▶ [参考文献\[PDF\]](#)

▶ [参考文献](#)

服务与反馈

▶ [把本文推荐给朋友](#)

▶ [加入我的书架](#)

▶ [加入引用管理器](#)

▶ [引用本文](#)

▶ [Email Alert](#)

相关信息

▶ [本刊中 包含“可转换债券”的 相关文章](#)

▶ [本文作者相关文章](#)

· [杨立洪](#)

· [蓝雁书](#)

· [曹显兵](#)