

基于随机Lagrange方法的最优套期保值策略

刘宣会,赵宁宁,续秋霞

收稿日期 修回日期 网络版发布日期 接受日期

摘要 将随机LQ控制模型推广到系统状态为跳跃-扩散过程的随机LQ模型,采用随机Lagrange方法得到最优反馈控制,然后运用该框架去处理数理金融中的套期保值问题,最后得到了最优套期保值策略.

关键词 [随机LQ控制](#) [跳-扩散模型](#) [套期保值](#) [随机Lagrange方法](#)

分类号

DOI:

对应的英文版文章: [2010061034](#)

扩展功能

本文信息

▶ [Supporting info](#)

▶ [PDF\(368KB\)](#)

▶ [\[HTML全文\]\(0KB\)](#)

▶ [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“随机LQ控制”的相关文章](#)

▶ 本文作者相关文章

· [刘宣会](#)

· [赵宁宁](#)

· [续秋霞](#)