

確率ボラティリティモデルにおける 解析的近似法について

MTEC 研究員
東京大学

山田 俊皓¹
高橋 明彦

要旨

本論文では、ファイナンスでのモデリングにおいてスタンダードになりつつある確率ボラティリティモデルのもとでのデリバティブの価格やインプライドボラティリティの解析的近似法と数値例を紹介する。また、離散バリアオプションへの応用についても扱う。

¹MTEC 久木田徹研究員、川口宗紀研究員、石谷謙介研究員、東京大学 加藤恭氏、立命館大学 田中秀幸氏とは、日頃から本研究内容を含めたテーマについて活発な議論を交わすことができました。この場を借りて御礼申し上げます。