

# یک روش تکراری برای یافتن زمان توقف بهینه در قرارداد اختیار برمودایی

محمد رسول مهدبی\*، دکتر محمود شفیعی،

1397-6-22

یک روش تکراری برای محاسبه زمان توقف بهینه برمودایی را با توجه به پوش اسنل برمودایی نمایش می‌دهیم. روش یک دنباله صعودی از تقریب‌های پوش اسنل از پایین که در آن بعد از تعداد زیادی متناهی گام به پوش اسنل منطبق می‌شود را تولید می‌کند. سپس با استفاده از دوگان، روش یک دنباله همگرا از کران‌های بالا را به خوبی موجب می‌شود. در حیطه مارکوفی، روش اجازه می‌دهد تا جواب‌های تقریبی با تعداد کمی امیدهای شرطی تودرتو را محاسبه کند. روش ممکن است یک حالت عمومی را برای مسائل توقف بهینه گسسته در نظر گرفته باشد. قدرت روش برای قراردادهای معاوضه برمودایی در یک مدل بازار لایبور تمام فاکتوری مشخص می‌شود.

کلمات کلیدی : واژگان کلیدی: اختیارهای برمودایی، توقف بهینه، شبیه‌سازی مونت کارلو، مدل بازار لایبور

[Islamic Azad University, Rasht Branch - Thesis Database](#)  
[دانشگاه آزاد اسلامی، واحد رشت - سامانه بانک اطلاعات پایان نامه ها](#)