

БЕЗРУЧКО Л. В., БЕЛЯВСКИЙ Г. И.

**АЛГОРИТМ ВЫЧИСЛЕНИЯ БЕЗАРБИТРАЖНЫХ
ЦЕН ЕВРОПЕЙСКИХ ОПЦИОНОВ
ДЛЯ МОДЕЛИ ПОД УПРАВЛЕНИЕМ
СУБОРДИНИРОВАННОГО ПРОЦЕССА ЛЕВИ**

Содержание

§ 1. Введение.	97
§ 2. Постановка задачи.	98
§ 3. Обобщенное уравнение и обобщенная формула Блэка–Шоулса	99
§ 4. Обобщенное уравнение и обобщенная формула Блэка–Шоулса для европейско- го опциона Call.	100
§ 5. Субординированная модель.	100
§ 6. Вычисление справедливой цены европейского опциона Call в субординирован- ной модели.	101
§ 7. Обратный гауссовский субординатор	102
§ 8. Заключение	103
Список литературы	103