

目 錄

摘要	iii
ABSTRACT	iv
目錄	v
圖目錄	vi
表目錄	vii
第一章 緒論	1
1.1 研究動機與研究方法	1
1.2 文章架構	2
第二章 文獻回顧	3
2.1 Black-Scholes歐式選擇權評價模型	3
2.2 平賭過程評價方法	5
2.3 還原風險中立機率測度	5
2.3.1 無母數還原風險中立機率測度的方法	5
2.3.2 拉格朗日乘數法還原風險中立機率測度	7
2.4 賽局理論之簡介	10
第三章 由選擇權市場價格還原風險中立機率測度	16
3.1 選擇權套利模型	16
3.2 還原風險中立機率測度	22
3.3 考慮交易成本	23
第四章 實證分析	26
4.1 資料來源	26
4.2 實證方法與結果分析	26
4.2.1 套利機會的篩選	27
4.2.2 風險中立機率測度的型態	32
4.2.3 市場上買權與賣權的價格合理性	35
第五章 結論	42
參考文獻	43