

國立政治大學應用數學系

碩士學位論文

指導教授：陳松男 博士

位移與混合型離散過程對波動度模型之  
解析與實證

Displaced and Mixture Diffusions  
for Analytically-Tractable Smile Models

碩士班學生：林豪勵 撰

中華民國九十七年十二月