


國立政治大學應用數學系

碩士學位論文

指導教授：廖四郎 博士

吳柏林 博士



利用最小平方蒙地卡羅法評價

百幕達式利率交換選擇權

Pricing Bermudan Swaption by
Least-Squares Monte Carlo Method

碩士班學生：陳妙津 撰

中華民國九十五年六月