

國立政治大學應用數學系

碩士學位論文

指導教授：劉明郎 博士

由選擇權市場價格建構具一致性之評價模型

—使用線性規劃

**Building a Consistent Pricing Model from
Observed Option Prices via Linear Programming**

碩士班學生：劉桂芳 撰

中華民國九十四年六月