

東 海 大 學  
數 學 系  
碩 士 論 文

*CIR* 模型對債券的歐式選擇權之評價計算

Numerical Approach Pricing European Options  
on Bond in CIR Model



研 究 生：廖 偉 辰  
指 導 教 授：葉 芳 柏

中 華 民 國 九 十 三 年 三 月

*CIR* 模型對債券的歐式選擇權之評價計算

Numerical Approach Pricing European Options  
on Bond in CIR Model

研 究 生：廖偉辰

Student : Wei-Chen Liao

指 導 教 授：葉芳柏

Advisor : Fang-Bo Yeh

東 海 大 學

數 學 系

碩 士 論 文

A Thesis Submitted to  
Department of Mathematics College of Science  
Tunghai University  
for  
the Master of Science  
in  
Applied Mathematics  
March 2004

Taichung, Taiwan, Republic of China.

中 華 民 國 九 十 三 年 三 月

## 誌 謝

在此非常感謝葉芳柏老師在這兩年多來的辛苦指導，提供許多寶貴的資料及建議。並感謝許元春老師與黃皇男老師給予本篇論文許多寶貴的意見。另外也非常感謝系所在本篇論文寫作的過程中提供充分的資源與環境。最後感謝家人在此期間的體諒，還有如慧與詩舫給予的鼓勵與協助，使本篇論文得以順利完成。

願將此成果與你們共享。

廖 偉 辰          謹識於  
東海大學應用數學研究所