

國立臺北大學統計學系

專題演講

講題：基於凱利法則的選擇權交易策略建構

主講人：吳牧恩 助理教授 (東吳大學數學系)

時間：106 年 3 月 8 (星期三，13:00~15:00)

地點：三峽校區商學大樓商 **3F13** 教室

Abstract

資金管理是交易策略最重要的一環，傳統上資金管理由凱利法則出發，其後推廣至最佳化比例、槓桿空間模型。然而，理論與實務在交易上有很大的差距。本演講將探討資金管理理論與實務上的問題，並提出方法去度量這之間的差異。此外，我們試圖將此差異最小化，並用於開發選擇權交易策略。本演講大綱如下：

1. 凱利公式能否用於交易？
2. 最佳化比例的迷思
3. 選擇權交易策略架構

~歡迎參加~

國立臺北大學統計學系 敬邀

106.03.01