

符号计算理论及软件实现

陈正^{1,2}, 秦志²

(1. 北京航空航天大学 数学与系统科学学院, 北京100083; 2. 中国科学院信息工程研究所, 北京100093)

摘 要

关键词

The valuation of swaption with counterparty risk under a multi-factor time-varying Markov chain model

CHEN Zheng^{1,2}, QIN Xue²

(1. BeiHang University, School of Mathematics and Systems Science, Beijing 100083, China;
2. Institute of Information Engineering, CAS, Beijing 116024, China)

Abstract

Keywords

1 引言

表1 不同计算平台的程序实现时间

	Maple	Magma	Polybori	Singular	Sage
平均时间(s)	0.0352	0.0361	0.0385	0.0402	0.0433
总时间(s)	0.0176	0.0166	0.0153	0.0137	0.0076

参考文献

- [1] 孙霞, 苏佳. 符号计算算法模型研究[J]. 系统工程理论与实践, 2013, 33(1): 1–11.
- [2] 席酉民, 王亚刚. 和谐社会秩序形成机制的系统分析: 和谐管理理论的启示和价值[C]// 中国系统工程学会第十四届学术年会论文集, 2006: 18–29.
- [3] Turcotte D L. Fractals and chaos in geology and geophysics[M/OL]. New York: Cambridge University Press, 1992 [1998-09-23]. <http://wwwsegorg/reviews/mccorm30.html>.

收稿日期: 2015-06-14

资助项目: 项目名称(00000000)

作者简介: 陈正(1984–),男,博士研究生,研究方向: 信息安全.