

Topper, Jürgen; Heurich, Matthias

Working Paper

Pricing Basket Option - A Comparative Study

Diskussionsbeitrag, No. 223

Provided in Cooperation with:

School of Economics and Management, University of Hannover

Suggested Citation: Topper, Jürgen; Heurich, Matthias (1999) : Pricing Basket Option - A Comparative Study, Diskussionsbeitrag, No. 223, Universität Hannover, Wirtschaftswissenschaftliche Fakultät, Hannover

This Version is available at:

<https://hdl.handle.net/10419/78315>

Standard-Nutzungsbedingungen:

Die Dokumente auf EconStor dürfen zu eigenen wissenschaftlichen Zwecken und zum Privatgebrauch gespeichert und kopiert werden.

Sie dürfen die Dokumente nicht für öffentliche oder kommerzielle Zwecke vervielfältigen, öffentlich ausstellen, öffentlich zugänglich machen, vertreiben oder anderweitig nutzen.

Sofern die Verfasser die Dokumente unter Open-Content-Lizenzen (insbesondere CC-Lizenzen) zur Verfügung gestellt haben sollten, gelten abweichend von diesen Nutzungsbedingungen die in der dort genannten Lizenz gewährten Nutzungsrechte.

Terms of use:

Documents in EconStor may be saved and copied for your personal and scholarly purposes.

You are not to copy documents for public or commercial purposes, to exhibit the documents publicly, to make them publicly available on the internet, or to distribute or otherwise use the documents in public.

If the documents have been made available under an Open Content Licence (especially Creative Commons Licences), you may exercise further usage rights as specified in the indicated licence.

DRAFT
not available yet!!!

Pricing Basket Option:
A Comparative Study

Discussion Paper No. 223
ISSN 0949-9962
JEL C63, G13
MSC 35K20, 65M60

Version 10. September 2000

Matthias Heurich : Arthur Andersen
Financial and Commodity Risk Consulting
Mergenthalerallee 55
65760 Eschborn/Frankfurt
Germany
Matthias.Heurich@De.ArthurAndersen.com

Jürgen Topper: Arthur Andersen
Financial and Commodity Risk Consulting
Mergenthalerallee 55
65760 Eschborn/Frankfurt
Germany
Juergen.Topper@De.ArthurAndersen.com

Dept. of Economics
University of Hannover
Königsworther Platz
30167 Hannover
Germany