

线性风险容忍度效用下线性跳跃扩散过程的零息债券均衡定价

蒋贤锋, 齐飞

收稿日期 修回日期 网络版发布日期 接受日期

摘要 同时考虑到效用函数和禀赋价格动态过程的多样性,给出了代表性经济人具有线性风险容忍度效用并且禀赋遵循线性跳跃扩散过程时零息债券均衡价格的显示表达式,探讨了其收益率为常数的条件及禀赋过程满足均衡要求的条件.

关键词 [线性风险容忍度](#) [线性跳跃扩散](#) [零息债券](#) [均衡定价](#)

分类号

DOI:

对应的英文版文章: [2009010029](#)

通讯作者:

作者个人主页: 蒋贤锋, 齐飞

## 扩展功能

本文信息

- ▶ [Supporting info](#)
- ▶ [PDF \(462KB\)](#)
- ▶ [\[HTML全文\] \(0KB\)](#)
- ▶ [参考文献 \[PDF\]](#)
- ▶ [参考文献](#)

服务与反馈

- ▶ [把本文推荐给朋友](#)
- ▶ [加入我的书架](#)
- ▶ [加入引用管理器](#)
- ▶ [引用本文](#)
- ▶ [Email Alert](#)

相关信息

- ▶ [本刊中 包含“线性风险容忍度”的相关文章](#)
- ▶ 本文作者相关文章
  - [蒋贤锋](#)
  - [齐飞](#)