



[来稿须知](#)

[编辑流程](#)

[稿件版式](#)

[投稿信箱](#)

[在线期刊](#)

当前位置: [自然科学版](#) >> [第30卷](#) >> [第1期](#)

标的资产价值服从跳跃-扩散过程的美式实物期权定价研究

邱小丽¹, 柴俊²

(1. 温州大学城市学院, 浙江温州 3250352; 2. 华东师范大学数学系, 上海 200062)

摘要: 时间较长的投资机会对于目前来说是可以近似看作是永久的, 因此这样的不可逆的投资机会类似于永久美式看涨期权. 本文在初始投资成本是不确定的情况下, 探讨了跳幅服从均匀分布的泊松跳跃过程对这样的实物期权价值的影响, 发现跳跃过程会提高投资临界值, 推迟投资.

关键词: 投资机会; 实物期权; 跳跃-扩散过程; 临界值

[PDF全文下载:](#) [09106邱小丽29.pdf](#)