



首页
概况
研究机构
学者介绍
成果文库
文献数据
培训教育
对外交流

Search the Web

Find It

□ 您的位置: 首页 → 数技经济研究杂志 → 应用研究

基于阶跃——扩散过程的农业期权定价及订单农业合约

[摘要] 市场经济下的农业是典型的风险型产业。本文考虑利用期权定价指导订单农业,以转移农产品的市场风险。在假设农产品价格服从几何布朗—阶跃扩散过程的前提下,给出关于混合随机过程的欧式买入期权定价的数理方程;借助于实例数据,对影响订单农业合约价格的因素进行分析与探讨,其结论为提高农业生产者和经营者的利益,制定有效的农产品订单价格具有现实指导意义。

[关键词] 期权定价 阶跃—跳跃过程 订单农业 风险转移