



[首页](#)
[文献检索](#)
[期刊浏览](#)
[全文文献](#)
[引文检索](#)
[代查代借](#)
[参考咨询](#)
[自助中心](#)
[用户热线](#)
[帮助](#)

中国预印本服务系统

用户状态

您尚未登录NSTL网络服务系统
[去NSTL首页登录](#)

功能菜单

[分类浏览](#)
[文章检索](#)
[文章提交](#)
[系统介绍](#)

系统资讯

您好，目前预印本系统的用户信息已经并入NSTL网络服务系统之中，如果您要提交或者管理个人论文，请返回NSTL系统首页进行登录，然后再访问预印本系统；同时，新用户的注册也请到NSTL首页去完成。原“国外预印本门户”，因丹麦科技大学图书馆技术信息中心关闭其平台而停止服务。

分类浏览

【所属分类】： 自然科学-信息科学与系统科学

【标题】： 非对称信息条件下外部性期权问题分析

【作者】： 王丽娜

【摘要】： 描述了外部性期权投资者和经营者价值函数，分析了不同信息条件下外部性期权的最优投资决策。在非对称信息条件下，外部性期权经营者对于项目价值信息隐匿，这是一个具有逆向选择的委托代理问题。设计了以外部性期权管理当局利润数学期望最大为目标函数，以控污成本和污染预防水平作为状态方程的最优控制问题。应用极大值原理得出了外部性期权最优控污成本和污染评价水平的求解方案。最后，进行了外部性期权的仿真实验，验证了外部性期权上的分析结果。

【关键词】： 外部性期权；非对称信息；控污成本；污染预防水平；委托代理

【联系方式】： TEL.:13304960088 EMAIL:lina1976113@126.com

【发布时间】： 2006-04-22

【发表状态】： N未发表

【TITLE】： Analysis of Externality Option Problem under Asymmetric Information

【AUTHORS】： WANG lina

The externality options are enlargement of the financial options. Its essence is object item investment and policy decision of management. In this paper externality option functions of administrator and enterprise who release pollution are described. The optimization investment policy decision of the externality option has been analyzed under different information conditions. The enterprise of externality options hides the pollution-evaluation level information under asymmetry information. It is a principal-agent problem having the adverse selection. This paper designed that objective function is taken at the biggest mathematical expectation value of investment profit. The optimization control of the state equation is taken at pollution-control cost and pollution-evaluation level. Using maximal principle the found solution scheme of the externality options optimization pollution-control cost and pollution-evaluation level has been derived. Finally, the emulation experiment in the externality options was made. The analysis result of externality options is verified.

【KEYWORDS】： Externality options, Asymmetry information, Pollution-control cost, Pollution-evaluation level, Principal-agent

【ADDRESS】： TEL.:13304960088 EMAIL:lina1976113@126.com

【全文文件】： [1145702532476.doc](#)

[返回](#)

目前没有评论内容

[文献检索](#) | [期刊浏览](#) | [全文文献](#) | [代查代借](#) | [引文检索](#) | [热点门户](#) | [网络导航](#) | [参考咨询](#) | [预印本服务](#)

Copyright(C)2005 NSTL.All Rights Reserved 版权所有

国家科技图书文献中心咨询热线：800-990-8900 010 - 58882057 Email:services@nstl.gov.cn

地址：北京市复兴路15号 100038 京ICP备05017586号