

电力市场下基于实物期权理论的电网投资经济评价

吴雪峰, 张 焰

上海交通大学 电气工程系, 上海市 闵行区 200240

收稿日期 修回日期 网络版发布日期 接受日期

摘要

随着电力市场化改革的深入, 电网投资面临的市场环境日益复杂, 不确定因素不断增多。传统的投资评价方法往往忽略了不确定性和柔性管理的价值, 而实物期权理论是在不确定环境下的一种新的经济评价方法, 它较好地反应了投资中不确定性和决策灵活性的价值。本文对电网投资的期权特性及其所包含的期权价值进行了研究, 并采用B-S模型对不确定性进行经济分析, 使经济评价能够更真实地反映电网投资的实际价值。

关键词 [电力市场; 电网投资; 实物期权; B-S模型](#)

分类号 [TM715](#)

Research on Economic Evaluation of Power Grid Investment Based on Real Option Theory in Electricity Market

WU Xue-feng, ZHANG Yan

Department of Electrical Engineering, Shanghai Jiaotong University, Minhang District, Shanghai 200240, China

Abstract

Key words

DOI:

通讯作者

作者个人主页 [吴雪峰; 张 焰](#)

扩展功能

本文信息

- ▶ [Supporting info](#)
- ▶ [PDF\(OKB\)](#)
- ▶ [\[HTML全文\]\(OKB\)](#)
- ▶ [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](#)
- ▶ [复制索引](#)
- ▶ [Email Alert](#)
- ▶ [文章反馈](#)
- ▶ [浏览反馈信息](#)

相关信息

- ▶ [本刊中 包含“电力市场; 电网投资; 实物期权; B-S模型”的 相关文章](#)
- ▶ 本文作者相关文章

- [吴雪峰](#)
- [张 焰](#)