

科技管理创新

结合新产品扩散特征的实物期权定价模型研究

卢铭凯,

西南交通大学经济管理学院;

收稿日期 修回日期 网络版发布日期 接受日期

摘要 现有实物期权定价模型未能考虑新产品销售量所呈现的扩散特征,模型的分析结果与实际情况有较大差距。文章假设新产品价格服从几何布朗运动,并以Bass模型预测新产品的销售过程,运用二叉树方法,构建了离散时间状态下结合新产品扩散特征的实物期权定价模型,并得到新技术采用的最优时机。

关键词 [创新扩散](#) [实物期权](#) [Bass模型](#) [最优决策](#)

分类号

DOI:

对应的英文版文章: [2011-17-003](#)

通讯作者:

卢铭凯

作者个人主页: [卢铭凯](#);

扩展功能

本文信息

- ▶ [Supporting info](#)
- ▶ [\[PDF全文\]\(610KB\)](#)
- ▶ [\[HTML\]\(0KB\)](#)
- ▶ [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“创新扩散”的 相关文章](#)
- ▶ 本文作者相关文章

- [卢铭凯](#)
- 

