

國立交通大學

管理科學系

博士論文

No.012

不確定環境下之選擇權評價模型

The option pricing model under uncertainty  
environment

研究生：王詩韻

指導教授：李正福 教授

曾國雄 教授

中華民國九十四年五月

# 國立交通大學

管理科學系

博士論文

No.012

不確定環境下之選擇權評價模型

The option pricing model under uncertainty

environment



研究生：王詩韻

研究指導委員會：李正福 教授

曾國雄 教授

游伯龍 教授

楊 千 教授

指導教授：李正福 教授

曾國雄 教授

中華民國九十四年五月

不確定環境下之選擇權評價模型

The option pricing model under uncertainty  
environment

研究生：王詩韻

Student：Shin-Yun Wang

指導教授：李正福

Advisor：Cheng-Few Lee

曾國雄

Gow-Hshiung Tzeng

國立交通大學



A Dissertation

Submitted to Department of Management Science

College of Management

National Chiao Tung University

in Partial Fulfillment of the Requirements

for the Degree of

Doctor of Philosophy

in

Management

May 2005

Hsin-Chu, Taiwan, Republic of China

中華民國九十四年五月