

<<石油金融衍生品市场价格波动研究>>

图书基本信息

书名：<<石油金融衍生品市场价格波动研究>>

13位ISBN编号：9787505889507

10位ISBN编号：7505889508

出版时间：2010-1

出版时间：经济科学出版社

作者：刘敏

页数：174

版权说明：本站所提供下载的PDF图书仅提供预览和简介，请支持正版图书。

更多资源请访问：<http://www.tushu007.com>

## <<石油金融衍生品市场价格波动研究>>

### 内容概要

解铃还需系铃人，为了化解中国目前面临的石油价格波动风险，最有效的办法就是以更加市场化的手段来管理中国石油价格，即建立自己的石油金融衍生品市场体系。

本书所要建立的石油金融衍生品市场体系，是这样一种价格形成机制，该机制使得石油金融衍生品的价格波动，及时传导到石油现货市场上，成为现货价格的基准价格或参考价格；同时，通过衍生品市场的预期传导机制，现货交易价格也将通过石油金融衍生品的交易者的理性预期传导到衍生品市场上，并综合社会各界因素，形成衍生品市场价格的波动，真实地反映未来现货市场供需情况的变化，发挥石油衍生品市场发现价格、稳定价格、回避价格波动风险的作用。

本书还设计了以成为亚洲能源衍生品交易中心为目标的石油金融衍生品市场价格体系的战略规划，以长期保障作为石油消费大国的中国的利益，保障国家的石油安全。

正如计算机内的缓存可以保障计算机运行安全、稳定、高效一样，建立自己的石油金融衍生品市场将对管理中国石油价格波动风险，提高中国市场经济运行效率意义重大。

本书所作出的创造性工作及意义，在相应章节的总结部分以及第7章结论部分已做了论述，在此处作一简要概括。

## <<石油金融衍生品市场价格波动研究>>

### 作者简介

刘敏，1975年5月生于安徽省蚌埠市，2002年1月于安徽财经大学国际经济贸易学院产业经济学专业获经济学硕士学位，2008年1月于上海财经大学工商管理学院产业经济学专业获经济学博士学位，现为安徽财经大学国际经济贸易学院，副教授，主要研究方向为期货贸易、流通产业组织等。近年来，主持教育部和安徽省教育厅课题研究各一项，参加安徽省自然科学基金课题研究一项，参加省、市级各类横向课题研究十余项，发表论文多篇。

# <<石油金融衍生品市场价格波动研究>>

## 书籍目录

第1章 引言1.1 研究的目的和意义1.2 问题的提出1.3 选题的背景1.3.1 中国经济发展与石油价格飙升1.3.2 国际金融衍生品市场价格与现货市场价格一体化趋势日益加强1.4 相关领域国内外研究现状与评述1.4.1 关于石油定价理论1.4.2 关于石油价格波动的研究1.4.3 关于金融衍生品价格与现货价格关联性的研究1.5 研究方法和结构安排1.5.1 研究方法1.5.2 结构安排第2章 国际石油价格波动及原因分析2.1 世界油价的波动2.1.1 20世纪60年代之前跨国石油公司的垄断定价2.1.2 1973年以前油价稳定2.1.3 1973~1985年的两次石油危机2.1.4 1986年以来的油价的起伏2.1.5 2003年至今油价的大幅攀升2.2 影响石油价格波动的因素2.2.1 石油供应2.2.2 石油消费2.2.3 石油库存2.2.4 能源替代2.2.5 突发事件与政治因素2.2.6 石油期货2.3 本章小结第3章 国际石油价格形成机制3.1 以期货为核心的国际石油定价机制3.1.1 期货市场为主导的石油定价机制3.1.2 国际石油定价基准3.2 石油金融衍生品在价格形成中的一体化作用3.2.1 期货——现货市场定价依据3.2.2 期权——有效的对冲战略3.2.3 远期——场外交易的价格标杆3.2.4 互换——灵活的保值手段3.3 石油金融衍生品市场价格与理性预期3.3.1 金融衍生品市场上的预期行为3.3.2 石油金融衍生品市场中的理性预期3.4 本章小结第4章 基于神经网络的石油期货价格波动研究4.1 价格波动预测BP网络的基本模型4.1.1 石油价格波动预测BP网络模型结构4.1.2 BP网络模型的算法4.2 石油期货价格波动预测BP网络的建立与测试4.2.1 价格波动预测BP网络的构建.....第5章 石油金融衍生品市场价格波动风险管理第6章 管理中国石油价格波动风险第7章 结论参考文献附录后记

版权说明

本站所提供下载的PDF图书仅提供预览和简介，请支持正版图书。

更多资源请访问:<http://www.tushu007.com>