

<<煤炭价格风险管理理论与方法研究>>

图书基本信息

书名：<<煤炭价格风险管理理论与方法研究>>

13位ISBN编号：9787802571013

10位ISBN编号：7802571014

出版时间：2010-1

出版时间：经济日报出版社

作者：郝家龙

页数：357

字数：270000

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>

## <<煤炭价格风险管理理论与方法研究>>

### 内容概要

本书以管理科学、风险管理理论、金融工程学、金融计量经济学、系统科学等理论知识为基础，回顾了我国煤炭价格的形成机制，并对当前的煤炭价格形成机制进行了研究，以因素分析法研究了影响煤炭价格形成的主要因素，对现行煤炭价格形成机制的缺陷进行了分析。

书中运用计量经济学的知识，对我国煤炭价格短期与长期波动的特征进行了定量研究，指出煤炭价格是非平稳的二级单整序列；对风险度量的理论和方法进行了概述，并运用国际金融理论界最为前沿的VAR技术对我国的煤炭价格风险进行了度量；在分析国内外煤炭期货运行状态的情况下，对我国实行煤炭期货规避煤炭价格风险的可行性、难点及解决措施进行了研究，提出了建立我国煤炭期货的基本思路：对期权与互换理论在煤炭价格风险管理中的应用，进行了进一步的研究，提出了运用煤炭期权管理煤炭价格风险的基本策略和煤炭企业及其下游企业运用煤炭期权规避价格风险的几种基本技术。

同时，书中对煤炭互换的原理和方法以实例进行了研究；鉴于价格指数在金融衍生产品运用的重要地位，对我国的煤炭价格指数进行理论上的设计，并提出了相应的数学模型。

最后，由于预测是煤炭企业及其中游企业管理价格风险、做出决策的重要前提，对煤炭价格的预测方法进行了研究，得出了对于煤炭价格的短期走势预测，Box-Jenkins法优于灰色系统理论的结论。

## 作者简介

郝家龙，1993年毕业于山西经济管理学院国民经济管理专业，毕业后任职于太原理工大学阳泉学院。

1997年攻读管理学硕士，师从张顺江教授，对决策学、财务和管理等学科有一定研究，2008：获管理学硕士学位。

2004年攻读博士学位，专业为金融工程与风险管理，2007年6月获金融学博士学位，对计量经济等有一定的研究和应用基础。

曾任太原理工大学阳泉学院科学技术协会秘书长、系主任。

承担各项课题五项，其中获山西省软科学一等奖一项，中国教育协会二等奖一项。

主编教材三部，出版专著二部。

在各类学术期刊发表学术论文三十余篇，其中国家级论文十余篇。

主要从事经济理论、经济政策及区域经济发展方面的研究工作。

现任太原理工大学阳泉学院计划财务与资产管理处处长。

书籍目录

第1章 引言

- 1.1 风险与风险管理的基本范畴
  - 1.1.1 风险及相关概念
  - 1.1.2 风险管理的定义、基本方法及程序
  - 1.1.3 风险管理理论发展综述
- 1.2 问题的提出
  - 1.2.1 煤炭在我国能源安全战略中的地位
  - 1.2.2 煤炭价格市场化改革对煤炭价格风险的影响
  - 1.2.3 煤炭价格波动性的实证
- 1.3 研究的目的是和意义
  - 1.3.1 研究目的
  - 1.3.2 研究的意义
- 1.4 研究的创新点、主要内容与研究方法
  - 1.4.1 创新点
  - 1.4.2 研究的主要内容及相应的研究方法
  - 1.4.3 分析的主要工具

第2章 煤炭价格形成的机制

- 2.1 煤炭价格形成机制概述
  - 2.1.1 我国煤炭价格形成机制的发展形式
  - 2.1.2 计划机制下的煤炭价格影响因素及其形成机制的评析
- 2.2 基于市场经济的煤炭价格形成机制的结构模型
- 2.3 煤炭消费(需求)及其影响因素的计量分析
  - 2.3.1 煤炭消费与国民经济增长的协整性与因果关系研究
  - 2.3.2 各产业与煤炭消费的协整与因果关系分析
  - 2.3.3 第二产业与煤炭消费的协整性与因果关系分析
  - 2.3.4 第三产业与煤炭消费的协整性与因果关系分析
- 2.4 煤炭价格与煤炭需求量、替代能源价格的协整与因果分析
  - 2.4.1 煤炭价格与煤炭需求量的协整与因果分析
  - 2.4.2 煤炭价格与替代能源价格的协整与因果分析

.....

- 第3章 煤炭价格时序的波动特征
- 第4章 煤炭价格风险分析与计量
- 第5章 金融衍生品在煤炭价格风险管理中的应用
- 第6章 煤炭价格指数的理论设计与应用
- 第7章 预测理论在煤炭价格管理中的应用
- 第8章 结论与展望

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>