

<<国际油气项目战略投资评价>>

图书基本信息

书名：<<国际油气项目战略投资评价>>

13位ISBN编号：9787030352873

10位ISBN编号：7030352874

出版时间：2012-8

出版单位：科学出版社

作者：周远祺，杨金强

页数：119

字数：150000

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>

<<国际油气项目战略投资评价>>

内容概要

《国际油气项目战略投资评价：实物期权视角》采用实物期权法结合随机过程、微分对策理论、随机最优控制理论等有关金融数学知识，通过Matlab软件编程对油气项目投资的关键领域及投资决策的风险规避和投资评价作了有效的针对性分析，得到了一系列对理论界和实业界研究人员具有参考意义的理论成果。

《国际油气项目战略投资评价：实物期权视角》首先系统阐述了实物期权基础理论，分析了实物期权理论的发展及在油气项目中的应用发展；然后，分析了油气项目投资决策的实物期权分析思想；最后，主要对油田开发项目的三种情况作了投资决策分析：油田开发项目的竞标价、投资时机的确定；油田开发方案的选择；延长油田开发项目投资期限的选择。

采用的实物期权模型主要是均值回复跳扩散模型，并与均值回复、几何布朗运动两个模型一起分别对以上三种情况作了比较分析。

最后根据1976～2010年的油气价格确定了均值回复跳扩散模型参数，对以上三种油田开发情况进行了实例研究，并与1948～2003年确定的参数进行了投资决策比较。

《国际油气项目战略投资评价：实物期权视角》的读者对象为金融数学、数量经济学、管理科学与工程等领域及油田开发的相关研究者、研究生、企业界的从业者。

<<国际油气项目战略投资评价>>

作者简介

周远祺，女，湖南相乡人，中国地质大学（武汉）管理学博士，财务管理专业硕士生导师，研究方向为数量金融、公司金融、矿产资源、能源工程投资风险管理。

主持、参与国家级、省级、校级科研项目五项，发表国内外相关论文十余篇。

杨金强，男，河北衡水人，湖南大学经济学博士，美国哥伦比亚大学商学院访问学者，现为上海财经大学“常任轨”助理教授，研究方向为数理金融，公司金融。

主持，参与国家级、省级科研项目多项，发表国内外相关论文十余篇。

<<国际油气项目战略投资评价>>

书籍目录

第1章 国际油气项目战略投资评价的意义

- 1.1 中国的石油安全及其战略选择
- 1.2 国际油气项目实物期权战略评价的研究意义
- 1.3 油气项目实物期权评价的起源和发展
- 1.4 油气项目实物期权评价理论的研究动态
- 1.5 本书关键结构和内容
- 1.6 本书特色

第2章 实物期权理论基础

- 2.1 期权理论简述
 - 2.1.1 期权基本类型及交易三要素
 - 2.1.2 期权的核心思想
 - 2.1.3 期权定价的重要理论基础
- 2.2 实物期权及其分类
 - 2.2.1 实物期权的内涵
 - 2.2.2 实物期权与不确定性的关系
 - 2.2.3 实物期权的分类
- 2.3 实物期权定价方法及定价理论的数理基础
 - 2.3.1 实物期权定价方法
 - 2.3.2 实物期权定价模型的数理基础
- 2.4 实物期权定价模型推导
 - 2.4.1 构建投资决策模型的步骤
 - 2.4.2 期权定价微分方程
- 2.5 实物期权投资决策分析的主要内容

第3章 国际油气项目实物期权分析思想

- 3.1 国际油气项目投资管理的基本概念-
 - 3.1.1 国际油气项目投资阶段及决策环节划分
 - 3.1.2 国际油气项目各阶段投资及产量情况
 - 3.1.3 国际油气项目的勘探、生产许可证
 - 3.1.4 国际油气项目投资的不确定性因素
- 3.2 国际油气项目投资的实物期权特性分析
 - 3.2.1 国际油气项目实物期权法适用的条件
 - 3.2.2 国际油气项目的实物期权特性
 - 3.2.3 国际油气项目的实物期权与金融期权的比较
- 3.3 国际油气项目投资决策实物期权分析的内容
 - 3.3.1 国际油气开发项目投资决策实物期权分析内容
 - 3.3.2 国际油田开发方案选择实物期权的分析内容
 - 3.3.3 国际油田开发延长投资期限的实物期权分析的内容
- 3.4 国际油田开发项目实物期权溢价和投资原则分析
- 3.5 国际油气项目运用实物期权投资决策分析法的意义

第4章 国际油气项目战略竞标及投资

- 4.1 油气价格的随机模型比较
 - 4.1.1 几何布朗运动随机过程
 - 4.1.2 均值回复随机过程
 - 4.1.3 均值回复跳随机过程
- 4.2 均值回复跳实物期权投资决策分析模型

<<国际油气项目战略投资评价>>

- 4.2.1 基本模型
- 4.2.2 方程求解
- 4.2.3 模型参数界定
- 4.3 基于Matlab算例的投资决策分析
 - 4.3.1 油气项目的租赁权和开采许可证的价值评估及决策分析
 - 4.3.2 油气项目投资的最佳时机分析
 - 4.3.3 投资经济环境波动对油气项目投资最佳时机的影响分析
- 4.4 与几何布朗运动实物期权模型比较
- 4.5 与均值回复实物期权分析的投资决策模型比较
- 4.6 与净现值方法的比较
 - 4.6.1 油气项目净现值的评价模型
 - 4.6.2 净现值法与实物期权法投资决策算例分析比较
- 第5章 国际油田开发方案战略选择
 - 5.1 新旧互斥油田开发方案选择原则分析
 - 5.1.1 NPV法互斥油田开发方案的选择原则分析
 - 5.1.2 互斥油田开发方案的实物期权选择原则分析
 - 5.1.3 改进的实物期权法互斥油田开发方案的选择原则分析
 - 5.2 均值回复跳的实物期权油田开发方案选择模型
 - 5.3 基于Matlab算例的方案选择分析
 - 5.3.1 算例的方案选择分析
 - 5.3.2 波动率对算例方案选择的影响分析
 - 5.4 三模型的投资决策比较
- 第6章 国际油田开发项目延期战略选择
 - 6.1 均值回复跳的延长投资期限的投资决策分析模型
 - 6.1.1 模型建立及求解
 - 6.1.2 延长投资期限的投资决策实物期权分析投资原则
 - 6.2 基于Matlab算例的延长投资期限的决策分析
 - 6.3 三模型的投资决策比较
- 第7章 国际油气项目战略投资经济环境分析
 - 7.1 1986~2010年为背景的均值回复跳模型的参数界定
 - 7.1.1 参数的界定
 - 7.1.2 油气价格的跳跃频率
 - 7.1.3 油气项目风险调整的贴现率
 - 7.2 油气项目实例情况
 - 7.3 国际油气项目投标的决策分析结果
 - 7.3.1 基于Matlab均值回复跳模型新参数投资分析的结果
 - 7.3.2 基于Matlab均值回复跳模型新旧参数对比投资分析的结果
 - 7.4 国际油田开发项目延长投资期限的决策分析结果
 - 7.4.1 基于Matlab均值回复跳模型新参数投资分析的结果
 - 7.4.2 基于Matlab均值回复跳模型新旧参数对比投资分析的结果
- 第8章 总结与展望
 - 8.1 总结
 - 8.2 展望
- 致谢
- 参考文献
- 附表I
- 附表2

<<国际油气项目战略投资评价>>

附表3

<<国际油气项目战略投资评价>>

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>