第一图书网, tushu007.com

<<能源和电力风险管理>>

图书基本信息

书名：<<能源和电力风险管理>>

13位ISBN编号：9787508366951

10位ISBN编号：7508366956

出版时间：2008-4

出版时间：中国电力出版社

作者：（美）艾德兰，（美）沃里尼克 著，王晗 译

页数：390

译者：王晗

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

第一图书网, tushu007.com

内容概要

本书全面介绍了评估和管理能源市场中复杂的衍生工具所带来的风险。
全书共10章，分别为：市场、基本产品和结构、相关数据、简化过程、远期价格过程、相关性、电价的混合模型、结构产品：燃料和其他商品、发电厂和跨商品衍生品、风险管理。
附录部分介绍了波动和相关结构下的多维准蒙特卡罗模拟：GBM情况及资产运营最优化。
　本书可供电力监管及电力市场专业人员使用，可作为培训教材，也可以作为一种普及读物，面向电力行业外愿意了解电力经济的各类人员。

作者简介

AIexander Eydeland。
博士，迈朗公司副总裁，公司研究所所长，他致力于研究支持市场营销、交易和风险管理的模型和战略，设计能源资产评价、优化及管理等系统。

书籍目录

《电力经济与管理译丛》总序致谢译者前言英文版序第1章 市场 1.1 作为实物商品的燃料和电力 1.2 燃料市场：石油和天然气 1.3 电力市场 1.4 其他市场：排放物、天气、煤和停电 1.5 电力市场经济学第2章 基本产品与结构 2.1 标准风险管理工具 2.2 奇异期权第3章 数据 3.1 数据分析统计方法 3.2 天然气和电力数据分析 3.3 远期曲线 3.4 波动结构 3.5 天气数据 3.6 需求 3.7 停机 3.8 均值回复第4章 简化过程 4.1 价格过程建模 4.2 构建能源应用的简化模型：基础模型 4.3 现货价格的几何布朗运动 4.4 更实用的价格分布模型 4.5 统计波动过程 4.6 更高维数的模型 4.7 跳跃扩散模型 4.8 状态转换模型 4.9 模型的扩展第5章 远期价格过程 5.1 简单模型 5.2 持续的期货曲线模型 5.3 市场模型 5.4 多商品情况下市场模型的执行第6章 相关性 6.1 概述 6.2 确定性协方差矩阵 6.3 随机协方差矩阵 6.4 多元相关 6.5 相关性与联合性第7章 电力价格的混合模型 7.1 生产成本和基础均衡模型 7.2 混合模型 7.3 简化混合模型 7.4 基础混合模型 7.5 模型 7.6 电力价格过程 7.7 混合模型的证明第8章 结构性产品：燃料及其他商品 8.1 看涨期权、看跌期权及两者的结合(上限期权、下限期权及双限期权) 8.2 摆动、回购及指定期权 8.3 亚式期权 8.4 掉期、掉期期权与展期 8.5 复合期权 8.6 差价期权 8.7 数字期权 8.8 天然气／石油存储 8.9 运输与传输 8.10 负荷服务和需求服务的合同 8.11 资产管理交易第9章 发电厂及其他跨商品衍生品 9.1 作为跨商品衍生品的电力价格 9.2 发电资产：火电机组 9.3 水电机组、炼油厂和其他实物资产 9.4 天气相关产品第10章 风险管理 10.1 风险调整 10.2 风险价值和其他风险度量法 10.3 实物资产和长期远期曲线 10.4 套期交易附录A 给定波动和相关结构下的多维蒙特卡罗(Monte Carlo)模拟：GBM实例附录B 实物资产运营的最优化参考文献

章节摘录

第1章　市场　　能源市场是性质各异的商品的集合，可将其分为三类：　　(1)燃料：石油、天然气、煤，以及它们的衍生品和副产品。
(2)电力。
(3)天气、排放物、纸浆和纸、强迫停电保险。
这种分类是与这些市场开放的历史步伐大体一致的。
燃料市场，尤其是石油和天然气市场，在20世纪80年代其批发领域就放开竞争了。
而电力市场也于20世纪90年代初期和中期在美国若干州相继开放。
在20世纪90年代末，与电力相关的新的商品类型，如天气和排放物也加快了交易步伐。
“燃料”这个词或许暗示了以电力为中心。
显然，石油和天然气也用于直接消费，并且，实际上，其作为加热燃料的需求促进了其价格的形成。
在我们更仔细地审视燃料市场与电力市场间的差异之前，让我们看看它们的共同点。
1.1 作为实物商品的燃料和电力　　任何有形商品除了投资价值外都有其独立价值，其市场涉及三类活动：生产、　　配送、消费。
这些活动又产生了几种服务，例如，天然气市场的配送包括将实物天　　然气从其源处经由收集系统运至加工设备．然后通过主管道到达接收端——其间　　可能暂停于储藏设备中以达到平衡的目的。
在放松管制之前，这个复杂的活动常由　　控制着当地大部分输配系统的一个实体完成。
自然，这种制度引起了我们对垄断势　　力的关注，并导致对该问题的严重管制，既控制了也搁置了该问题。
对管制的带来的效率低下的关注促使了解除管制的出台。
该过程需要两大因素：服务的分开或解捆(常是强制性的)和提供服务的市场的创建。
其中服务解捆的商品正是本书所要涉及的对象。

第一图书网, tushu007.com

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