

<<国际油价波动分析与预测>>

图书基本信息

书名：<<国际油价波动分析与预测>>

13位ISBN编号：9787811133851

10位ISBN编号：7811133857

出版时间：2008-10

出版时间：湖南大学出版社

作者：汪寿阳，余乐安，房勇 等著

页数：232

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>

## <<国际油价波动分析与预测>>

### 前言

近年来，全球石油价格呈现出大幅上涨和剧烈波动态势，油价不断刷新历史纪录并一直维持在高位。

2001年11月5日，WTI原油近月期货价格仅为17.45美元/桶，从2003年以来全球油价开始呈现出快速上涨走势，到2007年底WTI原油期货价格上涨至95.98美元/桶，较2003年初的31.85美元/桶上涨了208%，而2008年1月2日WTI原油期货价格更是创下了100美元/桶的历史新纪录。

此轮油价的大幅上扬和长时间高位运行，主要原因在于全球经济持续快速增长所带来的石油需求大幅增加导致了其供求关系趋于紧张。

此外，国际投机资本炒作与突发事件等因素也加剧了油价的上涨和波动幅度。

石油作为一种不可再生的基础能源和化工原料，其生产与供应直接关系到国民经济的正常运行和人民群众的生活质量。

同时，作为一种重要的战略物资，石油在国防安全和国家经济安全等领域有着特殊的重大意义。

随着世界经济的发展，石油需求将会持续增加，并且在可以预见的未来其仍将是世界上主要的能源之一。

目前，世界上绝大多数发达国家和发展中国家的经济发展在很大程度上都依赖着石油的消费，随着对石油依存度的增强，石油的重要性将会越来越凸显。

## <<国际油价波动分析与预测>>

### 内容概要

本书从影响国际油价的各个因素所构成的复杂系统出发，不仅研究了国际油价波动机制与预测中的若干关键问题，而且提出了多个新的预测方法和技术。

主要创新点包括：（1）利用计量经济理论，系统研究了国际主要原油市场之间的Granger因果关系和信息溢出效应；（2）利用经验模态分解方法，从一个新的视角解释了国际油价的形成机制；（3）利用经济计量方法与人工智能方法，分别对影响国际油价的短期、中期、长期因素进行了深入分析，为建立高效的国际油价预测模型奠定了基础；（4）根据不同的周期与数据频率，在不同的情景下，综合运用多种预测方法包括经济计量方法对国际油价的中长期走势做出了预测。

本书可作为从事预测工作的研究人员和相关专业的高等院校师生的阅读材料或培训教材，也可供从事石油行业和金融行业的专业人士与企业领导参考。

## <<国际油价波动分析与预测>>

### 作者简介

汪寿阳，博士，中科院数学与系统科学研究院研究员、副院长，中科院预测科学研究中心主任，中科院管理、决策与信息系统重点实验室主任，湖南大学特聘教授。

兼任中国运筹学会副理事长、中国系统工程学会副理事长、国务院学位委员会学科评议组成员、国家自然科学基金委员会专家咨询委员会委员、国家人事部“全国博士后专家管理委员会”委员以及国内外30余所知名大学的兼职教授或名誉教授。

先后被包括顶级期刊Energy Economics和Information and Management在内的12种国际学术期刊聘请为领域主编、副主编或编委以及8种国内重要期刊聘请为主编、执行主编、副主编或编委。

出版专著18部（其中在Springer-Verlag出版英文专著7部）、主编出版编著和文集12部（其中在海外出版7部）、在欧美学术期刊上发表论文180余篇（其中SCI和SSCI收录140余篇）。

## &lt;&lt;国际油价波动分析与预测&gt;&gt;

## 书籍目录

总序序言第一部分 国际油价波动分析 第一章 全球石油市场信息溢出研究 1.1 引言 1.2 信息溢出检验文献综述 1.3 实证研究 1.4 本章小结 1.5 参考文献 第二章 国际油价短期波动研究 2.1 引言 2.2 以前的相关研究 2.3 实证数据和方法 2.4 实证结果 2.5 本章小结 2.6 参考文献 第三章 基于粗糙集和小波神经网络的油价影响因素分析 3.1 引言 3.2 基于粗糙集和小波神经网络的混合方法 3.3 混合方法的应用 3.4 本章小结 3.5 参考文献 第四章 国际油价影响因素的综合分析 4.1 引言 4.2 影响原油供给的因素 4.3 影响原油需求的因素 4.4 影响原油价格的短期因素 4.5 本章小结 4.6 参考文献 第五章 突发事件对油价的影响分析 5.1 引言 5.2 突发事件类型 5.3 油价波动特点 5.4 案例分析：突发事件对油价的影响 5.5 本章小结 第六章 基于经验模态分解的国际原油价格波动分析 6.1 引言 6.2 经验模态分解 6.3 分解 6.4 合成 6.5 本章小结 6.6 参考文献 第七章 基于LSI的文本聚类在影响油价事件分类中的应用 7.1 引言 7.2 文本预处理 7.3 基于LSI的文本聚类 7.4 聚类结果分析 7.5 本章小结 7.6 参考文献第二部分 国际油价预测 第八章 动态因子方法预测原油价格 8.1 引言 8.2 动态因子方法 8.3 数据 8.4 回归和预测结果 8.5 本章小结 8.6 参考文献 第九章 基于基金持仓的国际原油期货价格预测 9.1 引言 9.2 影响国际原油期货市场的因素分析 9.3 国际原油期货价格预测 9.4 本章小结 9.5 参考文献 第十章 小波变换在油价分析预测中的应用 10.1 引言 10.2 小波变换 10.3 基于小波变换的油价序列多尺度分解 10.4 基于多尺度分解的油价预测 10.5 本章小结 10.6 参考文献 第十一章 基于小波神经网络的油价预测 11.1 引言 11.2 小波神经网络介绍 11.3 实证分析 11.4 本章小结 11.5 参考文献 第十二章 基于供求理论的石油季度价格预测 12.1 石油价格影响机制简介 12.2 石油季度价格影响因素分析 12.3 石油季度价格预测模型的建立 12.4 本章小结 12.5 参考文献 第十三章 勘探开发与国际石油供求间关系分析 13.1 引言 13.2 石油供给的影响因素分析与情景预测 13.3 石油需求的影响因素分析与情景预测 13.4 本章小结 13.5 参考文献 第十四章 基于VARX与VECM模型的年度国际原油价格预测 14.1 引言 14.2 模型理论与方法 14.3 变量选取与数据说明 14.4 模型预测与结论 14.5 本章小结 14.6 参考文献附录一 国际油价预测系列报告（摘选） 附录二 报刊文章和观点精选

## <<国际油价波动分析与预测>>

### 章节摘录

第一部分 国际油价波动分析 第一章 全球石油市场信息溢出研究 1.1 引言 近些年来,伴随着经济的高速发展,我国对能源的需求日益增大,原油消费和进口逐年递增。2003年我国超过日本成为全球第二大原油消费国,2004年我国原油消费量占到全球消费量的8%,进口原油占国内原油消费量的比重达到45.47%,2005年继续攀升至47.7%。

与此同时,近几年国际油价持续飙升,2005年美国两得克萨斯轻质油(WTI)价格较2004年上涨36.8%,达到平均每桶56.7美元;2006年7月14日达到每桶77.03美元。

由于原油在我国一次性能源消费中占较高的比例,高油价对我国经济的增长造成了负面影响。

一方面直接导致外汇支出增加,净出口减少,进而降低了GDP增长率,并拉动物价上升。

另一方面,高油价间接导致我国出口商品的成本增加,加之全球经济增长减速,使得我国出口面临下降的危险。

考虑到国际油价波动对我国经济贸易的巨大影响,加强对国际石油市场价格走势的研究和预测非常重要。

本章的目的在于刻画全球原油市场间的信息溢出,找出主导市场,以帮助国内有关部门和单位正确理解全球原油市场间的影响关系,并制定有效策略应对油价波动。

<<国际油价波动分析与预测>>

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>