

汉青经济与金融高级研究院“双周论坛”本学期第一次活动举办

时间:2008-09-11 来源:财金学院 作者:财金学院 点击:



9月10日，中国人民大学汉青经济与金融高级研究院和财政金融学院 联合举办的“双周论坛”本学期第一次活动在明德主楼714拉开序幕。汉青研究院汤珂老师做了一场题为“原油期货价格及其无套利收益的决定因素”的精彩报告。

汤珂老师于 2000年在清华大学获材料科学和工程学士学位和企业管理学士学位（第二学位），于 2002年在清华大学获材料学硕士学位，并于2004年取得美国加州大学伯克利分校Haas商学院金融工程硕士，之后获得英国剑桥大学Judge商学院金融学博士学位。现任教于中国人民大学汉青经济与金融高级研究院。

“原油期货价格及其无套利收益的决定因素”是汤珂老师近期研究的学术成果之一。在此次活动中，汤珂老师对这篇论文的基本假设，研究框架，研究方法和模型运用等方面做了详细生动的介绍。这篇论文通过提出一个三因素——短期、中期和长期——原油即期价格模型和研究这些因素与适当经济变量之间的关系而对这一问题进行了处理。该短期和中期因素的混合被认为是无套利收益。汤珂老师认为，短期因素主要涉及 现实市场上存货持有和撤出活动，以及期货市场上商业套期保值者的净卖空头寸，中期因素涉及利率和商业周期，而长期因素涉及石油公司股票价格及权益市场投资组合的表现。卖空理论和凯恩斯的正常现货溢价在决定期货价格中起着互补的作用。此次活动，坐无虚席，气氛轻松活跃，汤珂老师与师生们进行了热切的讨论与交流，并一一解答了老师们的疑问。



上一篇：[我院宿舍文明创建行动之定向越野素质拓展游戏大赛圆满举行](#)

下一篇：[“华尔街金融危机解读”系列讲座许小年专场聚焦自由市场制度](#)

新闻与事件

通知公告

财金新闻

讲座信息

专题报道

Copyright © 2002-2010. School of Finance, RUC 中国人民大学财政金融学院版权所有.

地址：北京市海淀区中关村大街59号明德主楼 100872

Designed by Great Way Business System