



首页
概况
研究机构
学者介绍
成果文库
文献数据
培训教育
对外交流

□ 您的位置: 首页 → 数技经济研究杂志 → 理论与方法研究

期货套期保值决策模型研究

内容提要: 期货套期保值模型的研究经历了传统全额套保、线性回归、线性均值一方差三个阶段,目前正在动态和非线性等方向上进行探索。为了解决以往模型无法描述套期保值者效用的非线性特征、无法利用套期保值者的现货价格知识以及不能更充分地给出套期保值决策分散性来源等缺陷,本文发展了套期保值决策的非线性均值一方差模型,将线性模型的结果作为特例并推广了线性模型,不仅对套期保值者的效用描述更为真实合理,而且使套期保值者利用现货价格知识改善套期保值操作成为可能,拓展了套期保值模型在期货定价理论和企业套期保值实践中的应用空间。

关键词: 期货 套期保值 非线性 模型

Search the Web

Find It

地址: 北京市建国门内大街5号 邮政编码: 100732 电话及传真: 010-65125895、010-65137561
版权所有 (c) 中国社会科学院数量经济与技术经济研究所
联系我们 E-mail to: iqte@cass.org.cn