

工程案例研究

欧洲碳排放权交易价格机制的实证研究

陈晓红,王陟昀,

中南大学商学院;

收稿日期 修回日期 网络版发布日期 接受日期

摘要 随着环境问题的日益严峻,作为一种市场化的减排方式—碳排放权交易逐渐受到越来越多的关注,也成为了众多学者研究的重点。以欧洲碳排放权交易体系为对象,研究其价格形成机制,分析了两阶段EUA价格的走势及其成因,建立了碳排放权交易价格模型,并检验了其适用性;然后分别以欧洲减排的第一阶段和第二阶段为独立样本,进行价格估计和预测。研究发现,EGARCH(1,1)-t模型适合用于EUA价格机制的研究,能够较好地估计和预测减排前两阶段的EUA价格,但是由于政治、交易制度、市场等方面原因,两个阶段的价格形成机制、价格波动性等方面存在较大差异。

关键词 [碳排放权交易](#) [价格机制](#) [EUETS](#) [EGARCH](#) [欧洲](#)

分类号

DOI:

对应的英文版文章: [2010-19-037](#)

通讯作者:

陈晓红

作者个人主页: 陈晓红;王陟昀;

扩展功能

本文信息

- ▶ [Supporting info](#)
- ▶ [\[PDF全文\]\(737KB\)](#)
- ▶ [\[HTML\]\(OKB\)](#)
- ▶ [参考文献\[PDF\]](#)

▶ [参考文献](#)

服务与反馈

- ▶ [把本文推荐给朋友](#)
- ▶ [加入我的书架](#)
- ▶ [加入引用管理器](#)

▶ [引用本文](#)

▶ [Email Alert](#)

相关信息

▶ [本刊中 包含“碳排放权交相关文章](#)

▶ 本文作者相关文章

- [陈晓红](#)
- [王陟昀](#)
-

