

# 《碳资产定价技术与方法》

## 图书基本信息

书名：《碳资产定价技术与方法》

13位ISBN编号：9787562347719

版权说明：本站所提供下载的PDF图书仅提供预览和简介以及在线试读，请支持正版图书。

更多资源请访问：[www.tushu111.com](http://www.tushu111.com)

# 《碳资产定价技术与方法》

## 内容概要

本书对碳金融资产定价的方法进行了系统的梳理，补充了国内在碳金融资产定价的空白，有助于指导本科生及研究生在碳金融领域的学习。具体内容包括：碳资产定价的理论基础、碳资产定价的主要方法以及具体到每一种碳资产的定价模型，如碳现货、碳期货、碳期权以及其他结构型产品。

## 书籍目录

### 1碳金融资产定价概述

#### 1.1碳金融资产定价的研究背景及意义

##### 1.1.1碳金融资产定价的研究背景

##### 1.1.2碳金融资产定价研究的意义

#### 1.2碳金融资产的基本概念

#### 1.3碳金融资产定价的基本原则

##### 1.3.1碳金融资产定价的特点

##### 1.3.2碳金融资产定价的功能

#### 1.4碳金融资产定价的基本要素、类型及体系

##### 1.4.1碳金融资产定价的基本要素

##### 1.4.2碳金融资产定价的类型及体系

#### 本章小结

#### 参考文献

### 2碳金融资产定价的理论基础

#### 2.1金融资产的价值构成理论

##### 2.1.1劳动价值论

##### 2.1.2效用价值论

##### 2.1.3新古典经济学的价值论

#### 2.2金融资产定价理论的基础知识

#### 2.3经典资产定价理论

##### 2.3.1马科维茨资产组合理论

##### 2.3.2资本资产定价理论

##### 2.3.3套利定价理论

##### 2.3.4期权定价理论

##### 2.3.5现代资产组合理论

#### 本章小结

#### 参考文献

### 3碳金融定价的主要方法

#### 3.1价值的概念及定价的基本步骤

##### 3.1.1价值的基本概念

##### 3.1.2定价基本步骤

#### 3.2基于成本法的碳金融资产定价

##### 3.2.1概述

##### 3.2.2成本法的影响因素与应用特点及定价程序

#### 3.3基于收益现值法的碳金融资产定价

##### 3.3.1概述

##### 3.3.2收益现值法定价原则与应用特点

##### 3.3.3定价程序

#### 3.4基于市场比较法的碳金融资产定价

##### 3.4.1概述

##### 3.4.2影响因素与应用特点

##### 3.4.3定价程序

#### 3.5三种定价方法的比较

##### 3.5.1三种定价方法的综合比较

##### 3.5.2三种定价方法两两之间的比较

#### 3.6基于层次分析法的综合定价方法的构建

##### 3.6.1综合运用三种常用资产定价方法的原则

- 3.6.2 层次分析法简介
- 3.6.3 综合定价方法的构建
- 3.7 其他定价方法在碳金融资产定价中的应用
  - 3.7.1 基本原理
  - 3.7.2 应用特点
- 3.8 实际运用：以股价的确定为例
  - 3.8.1 层次分析法在股票价值定价的具体应用
  - 3.8.2 用三种不同定价方法定价的股票价值
  - 3.8.3 股票价值的综合定价
- 本章小结
- 参考文献
- 4 碳价格变化因素与价格行为
  - 4.1 碳价格波动影响因素理论分析
    - 4.1.1 文献综述
    - 4.1.2 碳价格变动的影响因素
    - 4.1.3 碳排放权价格波动影响因素的理论分析
  - 4.2 碳价历史信息对当前价格波动的影响
    - 4.2.1 四类分析碳价变化的方法
    - 4.2.2 碳市场历史价格信息对当前价格的影响
    - 4.2.3 碳市场历史价格对碳价未来走势的影响
  - 4.3 流动性对碳价格波动的影响
    - 4.3.1 流动性风险指标的构建
    - 4.3.2 碳市场在险值计算和检验
    - 4.3.3 实例分析
  - 4.4 碳市场内部机制对碳价格波动性的影响
    - 4.4.1 碳市场内部机制对碳价波动的反馈作用
    - 4.4.2 碳市场内部机制对碳价波动的影响机制
  - 4.5 碳排放市场价格波动率的聚集效应
    - 4.5.1 实例分析
    - 4.5.2 ADF检验
    - 4.5.3 碳排放价格波动聚集效应
    - 4.5.4 异质性环境对碳价格波动的影响
- 本章小结
- 参考文献
- 5 碳信用资产的定价
  - 5.1 碳信用资产概述
    - 5.1.1 碳信用资产的定义
    - 5.1.2 碳信用资产的特点
  - 5.2 碳信贷定价
    - 5.2.1 商业银行碳信贷业务
    - 5.2.2 碳排放权贷款定价
  - 5.3 碳债券估值
    - 5.3.1 碳债券概述
    - 5.3.2 碳债券定价
- 本章小结
- 参考文献
- 6 碳排放权现货定价技术
  - 6.1 碳排放权的初始分配
    - 6.1.1 碳排放权交易的理论基础

- 6.1.2碳排放权常见初始分配方式
- 6.1.3碳排放权初始分配对二级市场的影响
- 6.2基于碳排放边际减排成本的现货定价
  - 6.2.1企业碳减排路径决策分析
  - 6.2.2碳排放边际减排成本
  - 6.2.3清洁发展机制下的碳排放权定价
- 6.3基于动态博弈的碳排放权定价
  - 6.3.1不完全信息动态博弈简述
  - 6.3.2碳排放权异质性模型
  - 6.3.3碳排放权的动态博弈均衡

本章小结

参考文献

## 7碳排放权期货定价技术

- 7.1碳期货价格基本理论
  - 7.1.1古典期货价格理论
  - 7.1.2现代期货价格理论
- 7.2碳期货定价技术
  - 7.2.1碳排放权作为投资性资产的期货定价
  - 7.2.2碳排放权作为消费性资产的期货定价
  - 7.2.3碳期货、现货价格关系
- 7.3碳期货应用
  - 7.3.1碳期货套期保值
  - 7.3.2碳期货套利交易

本章小结

参考文献

## 8碳排放权期权定价技术

- 8.1期权定价的主要步骤与方法分类
  - 8.1.1期权价格的特性与证券价格变化过程
  - 8.1.2期权定价的主要步骤
  - 8.1.3期权定价方法
  - 8.1.4期权定价方法比较
- 8.2碳排放权期权定价的B—S公式
  - 8.2.1B—S模型假设
  - 8.2.2B—S期权价值模型
  - 8.2.3B—S模型的应用
- 8.3碳排放权期权定价的二叉树模型
  - 8.3.1看涨期权价值的二叉树模型
  - 8.3.2二叉树定价模型的深入理解与应用
- 8.4碳排放权期权定价的鞅方法
  - 8.4.1鞅
  - 8.4.2等价鞅测度在期权定价中的应用

本章小结

参考文献

.....

## 9碳排放权结构性产品定价

# 《碳资产定价技术与方法》

## 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：[www.tushu111.com](http://www.tushu111.com)