

عنوان مقاله:

بازارهای آتی نفت و پوشش ریسک

محل انتشار:

دومین کنگره مهندسی نفت ایران (سال: 1386)

تعداد صفحات اصل مقاله: 13

نویسندگان:

علیرضا قنبری

محمدامین نادریان

خلاصه مقاله:

قراردادهای آتی به عنوان یکی از انواع مشتقات برای پوشش ریسک نوسانات قیمت در بازارهای مالی و کالا استفاده می-شود. از آنجایی که نوسانات قیمت نفت بالاست بیشتر معامل هگران این بازار مایل هستند به نحوی با ریسک قیمت مقابله کنند که قراردادهای آتی بدین منظور ابزار بسیار مناسبی هستند. این مقاله چگونگی پوشش ریسک نوسانات قیمت را با استفاده از قراردادهای آتی بصورت تئوری و تجربی با استفاده از مدل اقتصاد سنجی OLS نشان میدهد نتایج نشان م ی دهد که قراردادهای آتی ابزار بسیار خوبی برای کاهش ریسک هستند زیرا م میتوانند ریسک نوسانات قیمت را بین 86 تا 96 درصد کاهش دهند. این دامنه به نوع قرارداد آتی انتخابی بستگی دارد.

کلمات کلیدی:

قراردادهای آتی- پوشش ریسک- بازارهای مالی نفت- مشتقات مالی

لینک ثابت مقاله در پایگاه سیویلیکا:

<https://civilica.com/doc/146965>

