

<<目标函数、联动模式及估计方 >

图书基本信息

书名：<<目标函数、联动模式及估计方法>>

13位ISBN编号：9787514114515

10位ISBN编号：7514114513

出版时间：2011-12

出版时间：经济科学出版社

作者：付剑茹

页数：131

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：<http://www.tushu007.com>

## 内容概要

《目标函数、联动模式及估计方法——期货最优套期保值比求解三维度的实证研究》正是围绕这三个方面进行期货最优套期保值比研究的。

全书共分8章，主要内容与结论分述如下：

第1章，导论。

首先阐述本书的研究意义。

第2章，基于rcmrs的套期保值时变模型及实证研究。

第3章，基于状态空间模型的套期保值比卡尔曼滤波估计。

第4章，基于mcmc的期货最优套保比贝叶斯分析。

第5章，基于不同目标函数的最优套期保值比估计及比较研究。

第6章，基于蒙特卡洛模拟数据的期货最优套期保值比研究。

第7章，基于非期望效用框架下的最优套期保值比研究。

《目标函数、联动模式及估计方法——期货最优套期保值比求解三维度的实证研究》的最后部分为全书的结论及后续研究的展望。

书籍目录

第1章 导论

- 1.1 研究意义
- 1.2 国内外研究现状及研究趋势
- 1.3 研究思路、方法及技术路线
- 1.4 本书创新点

第2章 基于rcmrs的套期保值时变模型及实证研究

- 2.1 引言
- 2.2 研究评述
- 2.3 模型设定
- 2.4 实证分析
- 2.5 套期保值效率比较
- 2.6 本章 小结

第3章 基于状态空间模型的套期保值比卡尔曼滤波估计

- 3.1 文献回顾
- 3.2 模型设定
- 3.3 实证分析
- 3.4 套期保值有效性比较
- 3.5 本章 小结

第4章 基于mcmc的期货最优套保比贝叶斯分析

- 4.1 引言
- 4.2 贝叶斯定理
- 4.3 模型设定
- 4.4 模型的贝叶斯分析
- 4.5 实证分析
- 4.6 套期保值有效性比较
- 4.7 本章 小结

第5章 基于不同目标函数的最优套期保值比估计及比较研究

- 5.1 文献评述
- 5.2 模型设定
- 5.3 实证分析

第6章 基于蒙特卡洛模拟数据的套期保值比研究

- 6.1 基本的维纳过程
- 6.2 一般化的维纳过程
- 6.3 ito过程(ito process)
- 6.4 ito引理和商品价格的对数正态分布
- 6.5 持有成本理论
- 6.6 蒙特卡洛模拟(montecarlo simulation)
- 6.7 数据模拟及分析
- 6.8 经验分析

第7章 基于非期望效用框架下的最优套期保值比研究

- 7.1 效用函数设定
- 7.2 最优套期保值策略
- 7.3 无偏期货市场
- 7.4 现货溢价均衡(即期货价格升水)
- 7.5 期货溢价均衡(即期货价格贴水)

7.6内生性参考点的决定

7.7基于中国铜期货市场的实证检验

第8章 结论及研究展望

8.1结论

8.2研究展望

附录

参考文献

后记

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:<http://www.tushu007.com>