

# 金融市场仿真



[金融市场仿真 下载链接1](#)

著者:高宝俊

出版者:科学出版社

出版时间:2018-3-28

装帧:平装

isbn:9787030546357

基于Agent的仿真是一种新兴的经济建模方法，它通过模拟微观层面的个体行为及其相互作用机制，自底向上地得到宏观层面的市场动态特征。本书探讨如何利用基于Agent的仿真技术，研究金融市场中交易者的行为和市场微观结构对宏观层面的市场特征的影响。本书主要研究了如何建立基于Agent的连续竞价市场模型，不同的交易机制对市场格式化特征的影响，交易者间的互动行为的建模及其对市场的影响，以及股票市场与股指期货市场联动效应的建模与分析。

本书提供了各种模型的原理、实现思路和模型的运行结果，可作为金融工程、系统仿真等领域研究人员的参考书目。

作者介绍:

目录: 目录

第1章 绪论 1

1.1 金融交易数据的格式化特征 1

1.2 自底向上的微观仿真技术 3

1.3 基于Agent的金融市场仿真 7

1.4 本书的主要内容与框架 13

第2章 相关的理论与方法 18

2.1 Agent与多Agent系统 18

2.2 基于Agent的仿真模型的建模方法 24

2.3 基于Agent的仿真模型的实现方法 28

2.4 格式化特征的检验方法 34

第3章 基于Agent的连续竞价市场模型的建立与实现 41

3.1 模型的建立 41

3.2 基于Swarm平台的模型实现 52

第4章 价格形成机制对格式化特征的影响 58

4.1 问题的提出 58

4.2 所有Agent均为随机交易者时两种机制下仿真结果的比较 63

4.3 所有Agent均为基本分析者时两种机制下仿真结果的比较 70

4.4 小结 75

第5章 Agent的交易策略和涨跌幅限制措施对市场的影响 77

5.1 Agent的交易策略对市场的影响 78

5.2 涨跌幅限制措施实施效果的仿真研究 84

第6章 Agent间局部互动对格式化特征的影响 89

6.1 Agent间局部互动模型的建立 90

6.2 仿真结果与分析 94

6.3 仿真结果的讨论: 参数变动的影响 103

6.4 小结 111

第7章 股指期货市场的推出对股票市场的影响 113

7.1 两市场模型的建立 113

7.2 股指期货市场与股票市场波动性的关系的仿真研究 121

7.3 套期保值者和套利者的互动与市场崩跌现象的再现 127

7.4 小结 129

第8章 研究结论 131

参考文献 133

附录 142

附录1 连续竞价市场模型中主要Agent的定义 142

附录2 Agent间局部互动模型中极端收益的产生与模式的震荡过渡 149

附录3 两市场模型中主要Agent的定义 152

· · · · · (收起)

[金融市场仿真 下载链接1](#)

标签

金融市场

经济

建模

仿真

ABM

评论

---

[金融市场仿真 下载链接1](#)

书评

---

[金融市场仿真 下载链接1](#)