

基于特征变量的中国股票市场微观结构数量研究



[基于特征变量的中国股票市场微观结构数量研究 下载链接1](#)

著者:鲁万波

出版者:

出版时间:2011-7

装帧:

isbn:9787550402348

《学术研究 · 基于特征变量的中国股票市场微观结构数量研究：日内模式、持续时间与

《价格发现》从中国股市的特殊结构和各种约束出发，基于持续时间过程和标值点过程的数理建模理论，全面地考察了中国沪、深A、B股市场各市场微观结构特征变量的统计特征与日内模式，各市场微观结构特征变量之间的线性与非线性关系及其传导机制；重点研究了市场微观结构特征变量日内模式，金融持续时间的线性与非线性建模与应用，价格的形成、发现和变化机制这几个方面，在探讨中形成了“线性与非线性模型并用”、“参数与非参数时间序列分析交叉”、“日内时序数据与面板数据互补”的研究特色，为市场微观结构问题的研究提供了一条可行且特色鲜明的路径。

作者介绍:

目录:

[基于特征变量的中国股票市场微观结构数量研究 下载链接1](#)

标签

Microstructure

金融

金融学

日内模式

中国

评论

[基于特征变量的中国股票市场微观结构数量研究 下载链接1](#)

书评

[基于特征变量的中国股票市场微观结构数量研究 下载链接1](#)