

<<已实现波动率度量及其建模研究>>

图书基本信息

书名：<<已实现波动率度量及其建模研究>>

13位ISBN编号：9787560746890

10位ISBN编号：7560746896

出版时间：2012-10

出版时间：山东大学出版社

作者：田金方

页数：141

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>

## <<已实现波动率度量及其建模研究>>

### 内容概要

《已实现波动率度量及其建模研究》的第一个目的是利用高频数据的滤子技术，剔除市场微观结构效应的影响，给出纠偏后的新的已实现波动率度量。

第二个目的是利用度量好的已实现波动率，在充分考虑多成分异质市场驱动因素的基础上，提出新的波动率模型——HAR-L-M模型，它能给我们提供优越并且简单易行的波动率预测方法。

## <<已实现波动率度量及其建模研究>>

### 书籍目录

前言PREFACE第1章 引论1.1 研究背景和问题提出1.2 数据选取与清理1.3 本书主要工作概述1.3.1 研究思路1.3.2 研究方法与技术路线1.3.3 主要创新点1.4 本书结构安排第2章 已实现波动率研究综述2.1 单变量已实现波动率度量2.1.1 简单离散模型2.1.2 无市场微观结构效应的连续模型2.1.3 市场微观结构效应2.2 市场微观结构效应和已实现波动率2.2.1 频率选择与日历取样2.2.2 有偏修正与一致估计方法2.2.3 取样方案效应2.3 多变量已实现波动率度量2.4 已实现波动率建模和预测2.4.1 金融时间序列的典型特征及单变量情形2.4.2 多变量情形2.5 国内已实现波动率研究综述第3章 基于滤子技术的已实现波动率度量3.1 引言3.2 已实现波动率的阶特性3.3 自相关分析3.4 市场微观效应污染的价格过程模型3.4.1 个股价格模型3.4.2 股指价格模型3.5 滤子技术3.6 实证分析第4章 已实现波动率的典型特征分析4.1 数据频率的选择与已实现波动率度量4.2 收益率和已实现波动率的无条件分布4.2.1 收益率4.2.2 已实现波动率4.2.3 标准化收益率：已实现波动率与GARCH波动率的比较4.3 已实现波动率的动态特征4.4 已实现波动率的非对称特性第5章 已实现波动率建模及其预测分析5.1 波动率的典型特征5.2 资产收益率波动的驱动因素5.2.1 证券市场的多重分形特征5.2.2 有效市场和异质市场假说5.2.3 HAR-L-M模型机理5.3 HAR-L-M模型的建立5.4 模拟分析5.5 估计和预测5.5.1 参数估计5.5.2 模型预测效果比较第6章 结论和展望6.1 本研究工作总结6.2 本研究工作展望参考文献

<<已实现波动率度量及其建模研究>>

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>