

证券市场高频数据双相行为的仿真

刘兴华,梁晓蓓,杨海波

收稿日期 修回日期 网络版发布日期 接受日期

摘要 Plerou, et al 以证券市场高频数据为研究对象,通过实证分析发现了证券市场的“双相行为”(Two-phase behavior of financial markets). 这个现象是个复杂性涌现, Plerou猜想引起这个现象的原因是私人信息. 该文在少数派博弈模型的基础上,建立了一个市场人工模型, 仿真得到了同样的特征,并发现智能代理多样化的归纳推理模式是产生“双相行为”的关键因素,市场微结构也有一定的影响, 而私人信息不是关键因素.

关键词 [智能代理建模](#) [人工证券市场](#) [多样性和归纳推理](#) [双相行为](#)

分类号

DOI:

对应的英文版文章: [2009120147](#)

通讯作者:

作者个人主页: 刘兴华; 梁晓蓓; 杨海波

## 扩展功能

本文信息

- ▶ [Supporting info](#)
- ▶ [PDF](#) (1375KB)
- ▶ [\[HTML全文\]](#) (0KB)
- ▶ [参考文献\[PDF\]](#)
- ▶ [参考文献](#)

服务与反馈

- ▶ [把本文推荐给朋友](#)
- ▶ [加入我的书架](#)
- ▶ [加入引用管理器](#)
- ▶ [引用本文](#)
- ▶ [Email Alert](#)

相关信息

- ▶ [本刊中 包含“智能代理建模”的相关文章](#)
- ▶ 本文作者相关文章
  - [刘兴华](#)
  - [梁晓蓓](#)
  - [杨海波](#)