

博士论坛

(25B238)(975元)基于有限理性Agent的人工股票市场模型

姜继娇, 杨乃定

西北工业大学管理学院

收稿日期 2005-8-12 修回日期 网络版发布日期 接受日期

摘要 从现实交易者的有限理性角度, 描述了基于Agent的股票市场模型。研究设计了带有认知偏误的交易者Agent, 描述了多Agent之间的相互关系, 指出了心理因素在其中的重要作用。通过对连续双向拍卖交易收敛到竞争均衡过程的分析, 发现与有效市场假设相悖的结果。

关键词 [有限理性](#), [行为金融](#), [多智能体](#), [人工股票市场](#)

分类号

Artificial Stock Market Model Based on Bounded Rational Agent

JiJiao Jiang, NaiDing Yang

西北工业大学管理学院

Abstract

From the bounded rationality perspective of traders, it is described the stock market model based on Agent. The trader Agent is designed with cognitive biases. The mutual relationship among multi-Agent is given, influenced by psychological factors. With converging to the competitive equilibrium in continuous double auction, it shows paradox results with efficient market hypothesis.

Key words [bounded rationality](#) [behavioral finance](#) [multi-agent](#) [artificial stock market](#)

DOI:

通讯作者 姜继娇 jjj_leon8@hotmail.com

扩展功能

本文信息

▶ [Supporting info](#)

▶ [PDF\(OKB\)](#)

▶ [\[HTML全文\]\(OKB\)](#)

▶ [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](#)

▶ [复制索引](#)

▶ [Email Alert](#)

▶ [文章反馈](#)

▶ [浏览反馈信息](#)

相关信息

▶ [本刊中 包含“有限理性,行为金融,多智能体,人工股票市场”的相关文章](#)

▶ 本文作者相关文章

· [姜继娇](#)

· [杨乃定](#)