

图书基本信息

书名：<<DAC方法论及其在国际原油价格波动分析与预测中的应用>>

13位ISBN编号：9787030294562

10位ISBN编号：7030294564

出版时间：2010-12

出版时间：科学

作者：张珣//汪寿阳

页数：146

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>

内容概要

本书从复杂系统的特点出发，基于分而治之的思想，以经验模态分解算法为分解工具，以计量经济技术为影响因素分析方法，集成信号处理方法、时间序列模型和人工智能模型，提出了一个复杂系统分析和预测方法论——DAC方法论。

同时，将此方法应用到国际原油市场分析与预测中，以验证其有效性。

首先，基于经验模态分解算法对国际原油价格进行了多尺度分解，总结了国际油价在长期、中期和短期内的主要影响因素及波动特点；其次，针对三个重要的影响因素：重大突发事件、金融危机和投机活动，分别分析了其对原油市场的影响模式；最后，在系统评估期货市场对原油现货价格的预测能力，以及各种常用单变量预测模型对原油价格预测能力的基础上，构建了符合DAC方法论的集成预测模型：基于支持向量回归的多尺度预测模型，并探讨了原油价格的拐点预测问题。

本书对于从事预测科学和能源经济学研究的研究人员、政府有关决策和管理部门的工作人员、原油市场交易和相关企业的从业人员具有一定的参考价值。

本书也适合高等院校管理学院、金融学院、经济学院等相关专业的师生阅读、

书籍目录

总序前言第1章 绪论 1.1国际原油价格波动分析与预测的重要意义 1.2国际原油价格波动分析与预测的研究现状 1.3本书的结构与主要内容第2章 国际原油波动分析理论框架与方法 2.1国际原油波动分析理论框架：DAC方法论 2.2DAC方法论的模型与技术 2.2.1经验模态分解算法 2.2.2集合经验模态分解算法 2.2.3计量经济模型 2.2.4人工神经网络 2.2.5支持向量回归 2.2.6集成预测 2.3本章 小结第3章 国际原油价格波动影响因素分析 3.1引言 3.2原油价格分解 3.2.1数据 3.2.2IMF 3.2.3IMF统计分析 3.3原油价格主要影响因素分析 3.3.1趋势 3.3.2重大事件影响 3.3.3短期市场供需失衡和不规则事件的影响 3.4本章 小结第4章 影响因素研究：重大突发事件对原油价格的影响分析——基于EMD的事件分析方法 4.1引言第5章 影响因素研究：2007～2008年金融危机对原油价格的影响分析第6章 影响因素研究：投机因素对原油价格的影响分析第7章 原油价格预测：期货市场对市场的预测能力评估第8章 原油价格预测：单变量预测模型评估第9章 原油价格预测：EMD-SVR-SVR集成预测模型第10章 原油价格预测：先行指数方法第11章 原油价格预测：时变转移概率马尔科夫模型参考文献后记

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>