

<<财务危机动态预警模型研究>>

图书基本信息

书名：<<财务危机动态预警模型研究>>

13位ISBN编号：9787313072337

10位ISBN编号：7313072333

出版时间：2011-6

出版时间：上海交通大学出版社

作者：孙晓琳

页数：155

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>

## <<财务危机动态预警模型研究>>

### 内容概要

《财务危机动态预警模型研究》由孙晓琳编著，以“企业的财务危机具有持续性特点和累积效应”为出发点，综合运用滤波理论、财务危机动态预警理论和MATLAB编程技术，从时间序列角度和横截面角度建立了基于

Kalrman滤波的财务危机动态预警模型和BP神经网络的预警模型，对企业财务危机的动态预警理论和方法进行了系统深入的研究，并采用大样本、多变量、长时间序列的数据进行实证研究。

本书建立的理论依据，可以作为企业开展财务危机预警提供动态实时的决策辅助工具。

《财务危机动态预警模型研究》可作证券市场和上市公司分析人员的参考用书，可供高等院校相关专业的科研工作者、研究生参考。

# <<财务危机动态预警模型研究>>

## 书籍目录

### 第1章 绪论

- 1.1 研究背景及问题的提出
  - 1.1.1 研究背景
  - 1.1.2 问题的提出
- 1.2 研究的目的是和意义
- 1.3 国内外研究现状及分析
  - 1.3.1 财务危机概念界定的研究现状
  - 1.3.2 财务危机预警模型的研究现状
  - 1.3.3 财务危机预警指标体系的研究现状
  - 1.3.4 财务危机预警实证研究的现状
  - 1.3.5 国内外研究现状评述
- 1.4 本书的内容、方法和技术路线
  - 1.4.1 研究内容
  - 1.4.2 主要研究方法
  - 1.4.3 技术路线

### 第2章 财务危机动态预警的理论基础

- 2.1 财务危机的内涵
  - 2.1.1 财务危机和财务危机预警的界定
  - 2.1.2 财务危机的特征
  - 2.1.3 财务危机的原因分析
- 2.2 动态预警的理论基础
  - 2.2.1 预警理论
  - 2.2.2 企业生命周期理论
  - 2.2.3 质量过程控制理论
- 2.3 引发财务危机的影响因素分析
  - 2.3.1 财务状况恶化对财务危机的影响
  - 2.3.2 经营质量降低对财务危机的影响
  - 2.3.3 公司治理结构对财务危机的影响
- 2.4 动态预警指标体系的确定及定义
- 2.5 本章小结

### 第3章 财务危机预警动态数据分析与检验

- 3.1 样本公司的选择
  - 3.1.1 样本公司选择的依据
  - 3.1.2 样本的选择
  - 3.1.3 样本公司选择结果
- 3.2 动态系统数据的统计描述和检验
  - 3.2.1 动态系统数据的描述性统计和噪声预处理
  - 3.2.2 时间序列数据的参数检验和非参数检验
  - 3.2.3 变量间相关性分析
  - 3.2.4 动态系统数据空间维度的确定
- 3.3 公司治理截面数据的统计描述和检验
- 3.4 动态系统数据的标准正态化处理
- 3.5 全局主成分分析动态系统数据
  - 3.5.1 全局主成分法
  - 3.5.2 分析结果

## <<财务危机动态预警模型研究>>

### 3.6 本章小结

## 第4章 基于Kalman滤波构建企业财务危机预警模型

### 4.1 动态系统的状态空间描述

#### 4.1.1 时间序列分析

#### 4.1.2 状态空间模型

### 4.2 Kalman滤波算法

#### 4.2.1 Kalman滤波

#### 4.2.2 扩展Kalman滤波

### 4.3 Kalman滤波在财务危机预警中的适用性分析

#### 4.3.1 应用Kalman滤波的研究现状

#### 4.3.2 Kalman滤波在财务危机预警中的适用性

### 4.4 财务危机预警状况空间模型的建立

### 4.5 极大似然估计在模型参数辨识中的应用

#### 4.5.1 极大似然估计

#### 4.5.2 参数辨识

### 4.6 本章小结

## 第5章 动态模型有效性的分析与检验

### 5.1 分警度的财务危机阈值的确定

#### 5.1.1 不同警度的判定标准

#### 5.1.2 不同警度划分的结果

#### 5.1.3 预警阈值的确定

### 5.2 Kalman滤波模型结果的动态分析

#### 5.2.1 检测样本的财务状态结果

#### 5.2.2 检测样本的财务预测结果

#### 5.2.3 模型结果的动态分析与讨论

### 5.3 总体判别正确率分析

#### 5.3.1 预测精度的分析

#### 5.3.2 模型分类识别能力的检验

### 5.4 本章小结

## 第6章 公司治理视角下的BP神经网络财务危机预警模型

### 6.1 公司治理研究视角的完善

#### 6.1.1 公司治理指标的引入

#### 6.1.2 新近上市公司的特点

#### 6.1.3 神经网络的优势

### 6.2 BP神经网络的基本概念

#### 6.2.1 神经元模型

#### 6.2.2 BP神经网络及其结构

### 6.3 BP神经网络的设计和创建

#### 6.3.1 BP神经网络的设计

#### 6.3.2 BP神经网络的创建

### 6.4 BP神经网络的训练和仿真结果

#### 6.4.1 BP神经网络的训练

#### 6.4.2 BP神经网络的仿真及结果分析

### 6.5 两种财务危机动态预警模型的对比分析

### 6.6 本章小结

## 第7章 结论与展望

### 7.1 结论

## <<财务危机动态预警模型研究>>

### 7.2 进一步研究的方向

附录

附录1 样本公司信息

附录2 备选财务指标和经营指标的描述性统计

附录3 备选财务指标的非参数检验

附录4 备选财务指标的Person检验

附录5 备选治理指标的描述性统计

附录6 备选治理指标的非参数检验

附录7 备选财务指标的全局主成分分析

附录8 Matlab主程序内容

参考文献

后记

<<财务危机动态预警模型研究>>

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>